

# 创金合信产业臻选平衡混合型证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	41
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信产业臻选平衡混合	
基金主代码	016997	
交易代码	016997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 1 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	269,749,686.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信产业臻选平衡混合 A	创金合信产业臻选平衡混合 C
下属分级基金的交易代码	016997	016998
报告期末下属分级基金的份额总额	183,267,380.56 份	86,482,305.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于行业竞争格局良好的企业，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略：本基金遵循重点投资优势产业与行业内精选个股相结合的股票投资策略。本基金的股票投资将通过自上而下和自下而上相结合的方法，充分研究行业竞争格局，精选有投资价值的产业；在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间的背景下，结合估值水平，注重安全边际，选择内在价值被低估的股票构建投资组合。（1）行业配置策略：本基金主要通过行业景气度和行业竞争格局分析，就行业投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业景气度方面，本基金将重点投资于景气度较高且具有可持续性的行业；在行业竞争格局方面，本基金将重点投资于行业竞争格局良好的行业。（2）个股投资策略：本基金采用定性分析和定量分析相结合的方法，综合公开信息（包括财务数据）、第三方研究报告和研究员调研的结果，对目标上市公司的经营管理与投资价值进行深入研究，精选出优势产业及其相关行业估值相对合理的优质上市公司，构成本基金的投资组合。1）定性</p>

	<p>分析：一是公司治理方面，公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期，将选择公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明的上市公司。二是科研能力方面，选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在行业内具备一定技术壁垒的公司。三是竞争优势方面，重点考察公司是否拥有独特优势的物质或非物质资源，在细分市场是否占据领先地位，是否具有品牌号召力或较高的行业知名度等。2) 定量分析：一是估值水平方面，本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入(EV/SALES)、自由现金流贴现模型（FCFF, FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过估值水平分析，基金管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。二是盈利能力方面，本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力，主要参考的指标包括净资产收益率（ROE），毛利率，净利率，EBITDA/主营业务收入等。三是成长性方面，本基金重点关注成长性指标，包括预期主营业务收入增长率、净利润增长率、PEG 等，评估上市公司未来的盈利增长速度。（3）港股通标的股票投资策略：本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金采用"自下而上"精选个股策略。对上市公司进行系统性分析，其中偏重：估值采用多种估值方法，包括 P/E（预期）、P/B、PCF、PCF、相对于 NAV 的溢/折价、DDM、ROE，与历史、行业 and 市场的比较。①成长性：EPS 增长率、ROE 趋势、行业增长率、市场份额增长率以及增长来源。注重选股，选择具有持续领先优势或核心竞争力的企业，偏好具有优异管理能力及效率的公司。②独立思考：领先市场共识，寻找未被充分挖掘的企业。③注重估值：严谨基本面分析，判断合理估值水平，给予目标价。④长期投资：注重现金分红及资本增值，愿意承受短期盈余增长波动。（4）存托凭证的投资策略：本基金投资存托凭证的策略依照上述上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益品种投资策略：（1）债券投资策略。（2）资产支持证券投资策略。（3）可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>4、衍生产品投资策略：（1）股指期货、股票期权合约投资策略。（2）国债期货投资策略。</p> <p>5、其他。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率*50%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*40%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除可投资 A 股外，还可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95599
传真	0755-25832571	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518052	100031
法定代表人	钱龙海	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035华润前海大厦A座36-38楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

#### 1、创金合信产业臻选平衡混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年3月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-3,390,878.23
本期利润	-4,175,689.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0217

本期加权平均净值利润率	-2.21%
本期基金份额净值增长率	-2.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,911,055.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0213
期末基金资产净值	179,356,324.97
期末基金份额净值	0.9787
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.13%

## 2、创金合信产业臻选平衡混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 3 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,889,850.63
本期利润	-2,309,668.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0233
本期加权平均净值利润率	-2.36%
本期基金份额净值增长率	-2.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,014,496.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0233
期末基金资产净值	84,467,809.84
期末基金份额净值	0.9767
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.33%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 本基金合同生效日为 2023 年 3 月 1 日，截至报告期末，本基金成立不满半年。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

创金合信产业臻选平衡混合 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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

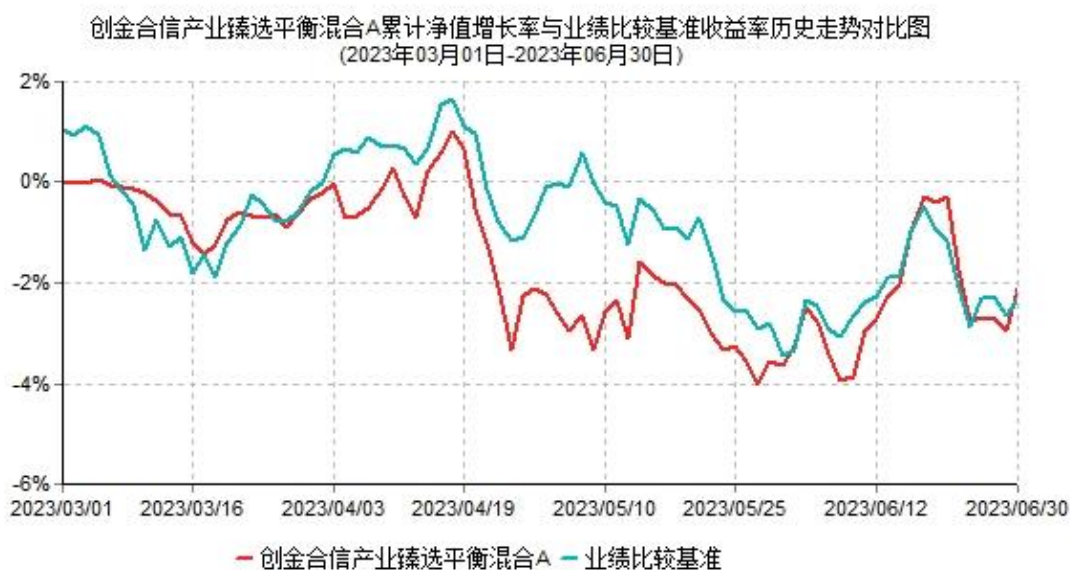


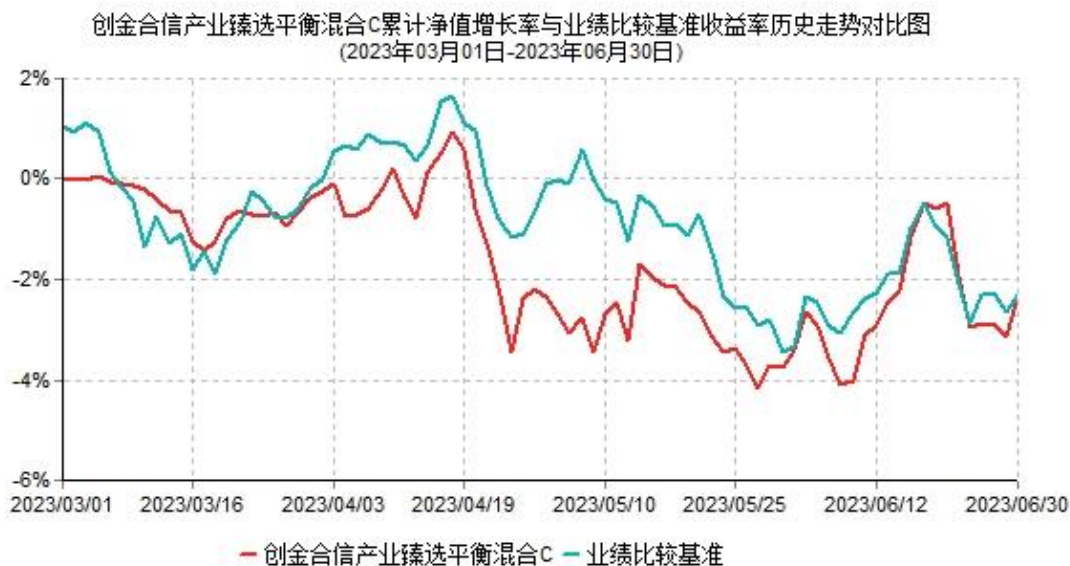
				④		
过去一个月	1.55%	0.66%	1.18%	0.52%	0.37%	0.14%
过去三个月	-1.92%	0.62%	-2.31%	0.49%	0.39%	0.13%
自基金合同生效起至今	-2.13%	0.54%	-2.32%	0.50%	0.19%	0.04%

创金合信产业臻选平衡混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.49%	0.66%	1.18%	0.52%	0.31%	0.14%
过去三个月	-2.08%	0.62%	-2.31%	0.49%	0.23%	0.13%
自基金合同生效起至今	-2.33%	0.54%	-2.32%	0.50%	-0.01%	0.04%

### 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





注：1、本基金合同于 2023 年 3 月 1 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。

## § 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 26,096 万元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.63596%。

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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
李游	本基金基金经理	2023 年 3 月 1 日	-	15	李游先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士。2007 年 7 月加入五矿期货有限公司，任研究部研究员，2011 年 9 月加入华创证券有限责任公司，任研究所研究员，2013 年 6 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理部研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，现任基金经理。

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金仓位有较大提升，持仓主要集中在新能源、顺周期和 AI 三个方向。报告期内本基金进一步减少了光伏一体化组件的配置，主要因为一体化组件公司受益于前期硅料价格的大跌、海运费降低以及美国出货增加，单瓦盈利非常高，但随着多晶硅价格触底以及明年光伏装机增速的大概率放缓，以及竞争的加剧，今年年底至 2024 年，一体化组件公司单瓦盈利有环比向下的可能；报告期内本基金维持电动车的重点配置，随着二季度碳酸锂价格企稳，中游产业链开始补库存，叠加电动车销量增速加快，下半年行业有望迎来反弹；报告期内本基金增加了少量户用储能行业的持仓，经过半年的去库存，欧洲户储去库存接近尾声，行业可以开始密切关注。报告期内本基金减少了顺周期行业的配置，主要因为国内经济复苏低于预期，若下半年出台刺激政策，顺周期行业有望迎来阶段性反弹的机会。报告期内本基金增加了 AI 行业的配置，AI 产业趋势非常明确，市场很快达成了共识，结构上算力端和包括机器人在内的应用端都有配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信产业臻选平衡混合 A 基金份额净值为 0.9787 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.13%，同期业绩比较基准收益率为-2.32%；截至本报告期末创金合信产业臻选平衡混合 C 基金份额净值为 0.9767 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.33%，同期业绩比较基准收益率为-2.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年 A 股市场整体表现低于预期，主要因为国内经济复苏低于预期，人民币贬值导致资金外流，A 股业绩和估值都承受了较大的压力。就具体行业来看，上半年市场还是有明显的结构性机会，主要是人工智能相关行业。展望下半年，预计上半年的利空因素会反转，7 月政治局会议明确了刺激经济的决心，预期在一系列举措之下，下半年国内经济复苏大概率会明显强于上半年，而美国加息已经接近尾声，下半年人民币汇率会稳定回升，外资也大概率会净流入，下半年 A 股市场表现大概率会强于上半年。行业配置上可以更加均衡，顺周期和新兴产业都有机会。

#### 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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—创金合信基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	116,716,454.28
结算备付金		354,763.62
存出保证金		44,782.48
交易性金融资产	6.4.7.2	151,736,408.57
其中：股票投资		151,736,408.57
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收股利		181,580.40
应收申购款		1,098.50
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		269,035,087.85
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		4,612,066.28
应付赎回款		96.87
应付管理人报酬		337,909.34
应付托管费		45,054.58
应付销售服务费		44,606.76
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	171,219.21
负债合计		5,210,953.04
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	269,749,686.40
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-5,925,551.59
净资产合计		263,824,134.81
负债和净资产总计		269,035,087.85

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信产业臻选平衡混合 A 份额净值 0.9787 元，基金份额总额 183,267,380.56 份；创金合信产业臻选平衡混合 C 份额净值 0.9767 元，基金份额总额 86,482,305.84 份；总份额合计 269,749,686.40 份；

2. 本财务报表的实际报告期间为 2023 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,611,638.18
1.利息收入		454,059.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	454,059.29
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,894,039.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,031,626.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	-
股利收益	6.4.7.15	1,137,587.10
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	-1,204,628.74
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	32,971.04
减：二、营业总支出		1,873,719.42
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,426,053.61
2.托管费	6.4.10.2.2	190,140.44
3.销售服务费	6.4.10.2.3	194,255.71
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
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	63,269.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,485,357.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,485,357.60
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-6,485,357.60

注：本财务报表的实际报告期间为 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-



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）	297,380,645.12	-	-	297,380,645.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,630,958.72	-	-5,925,551.59	-33,556,510.31
（一）、综合收益总额	-	-	-6,485,357.60	-6,485,357.60
（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）	-27,630,958.72	-	559,806.01	-27,071,152.71
其中：1.基金申购款	456,809.58	-	-12,526.16	444,283.42
2.基金赎回款	-28,087,768.30	-	572,332.17	-27,515,436.13
（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）	269,749,686.40	-	-5,925,551.59	263,824,134.81

注：本财务报表的实际报告期间为 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，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 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

创金合信产业臻选平衡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[2022]2398号《关于准予创金合信产业臻选平衡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《创金合信产业臻选平衡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 297,292,076.07 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2300398 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 297,380,645.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 88,569.05 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《创金合信产业臻选平衡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《创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、可转换债券、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金股票、可转换债券、可交换债券资产占基金资产的比例为 40%-80%(投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%)。每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证港股通综合指数收益率 $\times$ 10%+中债综合指数收益率 $\times$ 40%。

### 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》、《创金合信产业臻选平衡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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产

生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未

发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。暂估业绩报酬/附加管理费的估计方法为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提业绩报酬/附加管理费前）清算，根据基金份额持有人持有的基金份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬/附加管理费。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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的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；

2、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、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；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

本基金在本报告期末未发生会计政策变更。

### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	116,716,454.28
等于：本金	116,692,173.12
加：应计利息	24,281.16
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	116,716,454.28

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	152,941,037.31	-	151,736,408.57	-1,204,628.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	152,941,037.31	-	151,736,408.57	-1,204,628.74

#### 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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	111,414.81
其中：交易所市场	111,414.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,804.40
合计	171,219.21

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信产业臻选平衡混合 A		
项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	194,573,683.36	194,573,683.36
本期申购	104,142.46	104,142.46
本期赎回（以“-”号填列）	-11,410,445.26	-11,410,445.26
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	183,267,380.56	183,267,380.56

创金合信产业臻选平衡混合 C		
项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	102,806,961.76	102,806,961.76
本期申购	352,667.12	352,667.12
本期赎回（以“-”号填列）	-16,677,323.04	-16,677,323.04
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	86,482,305.84	86,482,305.84

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 2023 年 2 月 13 日至 2023 年 2 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 297,292,076.07 元，其中 A 类基金募集有效净认购资金为 194,510,780.00 元，其中 C 类基金募集有效净认购资金为 102,781,296.07 元。根据《创金合信产业臻选平衡混合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 88,569.05 元，在本基金成立后，折算为 88,569.05 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信产业臻选平衡混合 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	-3,390,878.23	-784,811.35	-4,175,689.58
本期基金份额交易产生的变动数	126,782.93	137,851.06	264,633.99
其中：基金申购款	-1,437.81	-1,343.51	-2,781.32
基金赎回款	128,220.74	139,194.57	267,415.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,264,095.30	-646,960.29	-3,911,055.59

创金合信产业臻选平衡混合 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	-1,889,850.63	-419,817.39	-2,309,668.02
本期基金份额交易产生的变动数	181,417.57	113,754.45	295,172.02
其中：基金申购款	-4,583.87	-5,160.97	-9,744.84
基金赎回款	186,001.44	118,915.42	304,916.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,708,433.06	-306,062.94	-2,014,496.00

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	451,354.85
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	2,566.05
其他	138.39
合计	454,059.29

## 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,031,626.87
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	-5,031,626.87

#### 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	106,938,790.50
减：卖出股票成本总额	111,675,998.45
减：交易费用	294,418.92
买卖股票差价收入	-5,031,626.87

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,137,587.10
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	1,137,587.10
----	--------------

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,204,628.74
——股票投资	-1,204,628.74
——债券投资	-
——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	-1,204,628.74

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	32,971.04
合计	32,971.04

#### 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	19,934.80
信息披露费	39,869.60
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,065.26
其他费用	400.00
合计	63,269.66

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 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	313,024,778.06	84.74%

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.1.4 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。

### 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	134,014.26	91.28%	111,414.81	100.00%

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

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,426,053.61
其中：支付销售机构的客户维护费	708,819.52

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	190,140.44

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 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 2023 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信产业臻选平衡混合 A	创金合信产业臻选平衡混合 C	合计
农业银行	-	24,354.44	24,354.44
合计	-	24,354.44	24,354.44



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 0.6% 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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 2023 年 3 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	116,716,454.28	451,354.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内（含）	新股未上市	26.68	26.68	3,701	98,742.68	98,742.68	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	4,472	89,395.28	89,395.28	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	36.90	36.90	1,674	61,770.60	61,770.60	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	1,988	51,330.16	51,330.16	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	67.28	65.43	250	16,820.00	16,357.50	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	23.80	32.84	356	8,472.80	11,691.04	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	46.16	35.72	325	15,002.00	11,609.00	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	32.29	51.12	216	6,974.64	11,041.92	-

		日		售						
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.68	26.68	412	10,992.16	10,992.16	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	38.13	31.03	349	13,307.37	10,829.47	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	35.66	33.26	306	10,911.96	10,177.56	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	19.99	19.99	497	9,935.03	9,935.03	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	30.22	25.50	374	11,302.28	9,537.00	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	14.81	13.73	659	9,759.79	9,048.07	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	72.50	58.42	144	10,440.00	8,412.48	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	25.25	19.69	410	10,352.50	8,072.90	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	36.90	36.90	186	6,863.40	6,863.40	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	39.06	39.36	168	6,562.08	6,612.48	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	32.60	30.37	206	6,715.60	6,256.22	-
301170	锡南科技	2023 年	1-6 个	创业板	34.00	34.93	175	5,950.00	6,112.75	-

		6月16日	月(含)	打新限售						
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	25.82	25.82	221	5,706.22	5,706.22	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	1-6个月(含)	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	24.66	22.51	224	5,523.84	5,042.24	-
001282	三联锻造	2023年5月15日	1-6个月(含)	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023年5月12日	1-6个月(含)	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

注：根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，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**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **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**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“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 2023 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	116,716,454.28	-	-	-	116,716,454.28
结算备付金	354,763.62	-	-	-	354,763.62
存出保证金	44,782.48	-	-	-	44,782.48
交易性金融资产	-	-	-	151,736,408.57	151,736,408.57
应收股利	-	-	-	181,580.40	181,580.40
应收申购款	-	-	-	1,098.50	1,098.50

资产总计	117,116,000.38	-	-	151,919,087.47	269,035,087.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	96.87	96.87
应付管理人报酬	-	-	-	337,909.34	337,909.34
应付托管费	-	-	-	45,054.58	45,054.58
应付销售服务费	-	-	-	44,606.76	44,606.76
应付清算款	-	-	-	4,612,066.28	4,612,066.28
其他负债	-	-	-	171,219.21	171,219.21
负债总计	-	-	-	5,210,953.04	5,210,953.04
利率敏感度缺口	117,116,000.38	-	-	146,708,134.43	263,824,134.81

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末无利率风险的敏感性分析。

#### 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。

本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					
	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	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	2,236,760.36	-	-	-	2,236,760.36
应收股利	-	181,580.40	-	-	-	181,580.40
资产合计	-	2,418,340.76	-	-	-	2,418,340.76
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	-	2,418,340.76	-	-	-	2,418,340.76

##### 6.4.13.4.2.2 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（2023年6月30日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	120,917.04
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-120,917.04

#### 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 2023 年 6 月 30 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	151,736,408.57	57.51
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	151,736,408.57	57.51

#### 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（2023年6月30日）
	1.业绩比较基准上升 5%	5,067,996.05
2.业绩比较基准下降 5%	-5,067,996.05	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	151,127,792.73
第二层次	438,879.57
第三层次	169,736.27
合计	151,736,408.57

##### 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，确定相关股票和债券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 2023 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。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 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	151,736,408.57	56.40
	其中：股票	151,736,408.57	56.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	117,071,217.90	43.52
7	其他资产	227,461.38	0.08
8	合计	269,035,087.85	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 2,236,760.36 元，占净值比为 0.85%。

## 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	-	-
B	采矿业	5,104,543.00	1.93
C	制造业	128,998,291.39	48.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	791,079.00	0.30
F	批发和零售业	52,726.64	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,394,578.43	4.32
J	金融业	2,366,280.00	0.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	707,392.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	84,757.75	0.03
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	-	-

S	综合	-	-
	合计	149,499,648.21	56.67

### 7.2.2 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（%）
原材料	2,236,760.36	0.85
合计	2,236,760.36	0.85

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	300750	宁德时代	52,380	11,984,020.20	4.54
2	002812	恩捷股份	110,700	10,665,945.00	4.04
3	002738	中矿资源	117,908	6,006,233.52	2.28
4	002050	三花智控	174,500	5,280,370.00	2.00
5	002459	晶澳科技	120,280	5,015,676.00	1.90
6	002709	天赐材料	110,000	4,530,900.00	1.72
7	603338	浙江鼎力	74,000	4,144,740.00	1.57
8	600438	通威股份	118,700	4,072,597.00	1.54
9	688599	天合光能	89,985	3,834,260.85	1.45
10	601012	隆基绿能	133,200	3,818,844.00	1.45
11	002129	TCL 中环	109,000	3,618,800.00	1.37
12	002463	沪电股份	172,200	3,605,868.00	1.37
13	002230	科大讯飞	50,050	3,401,398.00	1.29
14	002756	永兴材料	47,610	2,980,862.10	1.13
15	603993	洛阳钼业	509,300	2,714,569.00	1.03
16	001301	尚太科技	48,200	2,714,142.00	1.03
17	688111	金山办公	5,607	2,647,737.54	1.00
18	688256	寒武纪	13,948	2,622,224.00	0.99
19	601100	恒立液压	40,700	2,618,231.00	0.99
20	601138	工业富联	101,200	2,550,240.00	0.97
21	601899	紫金矿业	210,200	2,389,974.00	0.91
22	300033	同花顺	13,500	2,366,280.00	0.90
23	H00189	东岳集团	414,000	2,236,760.36	0.85
24	688223	晶科能源	152,995	2,151,109.70	0.82
25	300502	新易盛	28,380	1,928,988.60	0.73
26	002648	卫星化学	124,580	1,863,716.80	0.71

27	300408	三环集团	62,800	1,843,180.00	0.70
28	603806	福斯特	48,080	1,788,095.20	0.68
29	603728	鸣志电器	21,100	1,694,330.00	0.64
30	603799	华友钴业	36,900	1,694,079.00	0.64
31	002138	顺络电子	68,100	1,628,271.00	0.62
32	002920	德赛西威	10,100	1,573,681.00	0.60
33	688017	绿的谐波	9,414	1,528,833.60	0.58
34	603019	中科曙光	29,300	1,491,370.00	0.57
35	002271	东方雨虹	53,300	1,452,958.00	0.55
36	688348	昱能科技	7,472	1,403,465.76	0.53
37	600309	万华化学	15,700	1,379,088.00	0.52
38	002472	双环传动	37,900	1,375,770.00	0.52
39	300763	锦浪科技	13,100	1,363,710.00	0.52
40	000157	中联重科	199,600	1,347,300.00	0.51
41	600031	三一重工	79,500	1,322,085.00	0.50
42	300474	景嘉微	14,500	1,304,855.00	0.49
43	002156	通富微电	57,500	1,299,500.00	0.49
44	601689	拓普集团	16,100	1,299,270.00	0.49
45	688326	经纬恒润	8,762	1,265,145.18	0.48
46	601360	三六零	97,700	1,225,158.00	0.46
47	002850	科达利	8,300	1,097,675.00	0.42
48	688041	海光信息	15,701	1,071,907.27	0.41
49	002601	龙佰集团	54,800	904,200.00	0.34
50	002984	森麒麟	28,400	893,464.00	0.34
51	688608	恒玄科技	7,192	870,447.76	0.33
52	002859	洁美科技	30,000	831,000.00	0.31
53	688798	艾为电子	13,679	809,112.85	0.31
54	688032	禾迈股份	2,270	806,190.50	0.31
55	688677	海泰新光	14,155	803,154.70	0.30
56	600426	华鲁恒升	24,100	738,183.00	0.28
57	601636	旗滨集团	83,100	716,322.00	0.27
58	601888	中国中免	6,400	707,392.00	0.27
59	000988	华工科技	17,200	653,772.00	0.25
60	300769	德方纳米	5,440	599,651.20	0.23
61	000425	徐工机械	83,200	563,264.00	0.21
62	002444	巨星科技	24,000	525,120.00	0.20
63	300308	中际旭创	3,500	516,075.00	0.20
64	600176	中国巨石	36,200	512,592.00	0.19
65	002913	奥士康	12,800	488,704.00	0.19
66	301221	光庭信息	8,700	485,721.00	0.18
67	601186	中国铁建	49,300	485,605.00	0.18
68	600745	闻泰科技	9,700	474,330.00	0.18
69	688049	炬芯科技	12,707	467,617.60	0.18

70	603313	梦百合	38,600	387,158.00	0.15
71	688036	传音控股	2,336	343,392.00	0.13
72	601390	中国中铁	40,300	305,474.00	0.12
73	688099	晶晨股份	2,975	250,852.00	0.10
74	301269	华大九天	2,000	245,680.00	0.09
75	300458	全志科技	9,000	245,250.00	0.09
76	688535	华海诚科	3,800	232,294.00	0.09
77	603916	苏博特	15,800	209,192.00	0.08
78	300274	阳光电源	1,500	174,945.00	0.07
79	301310	鑫宏业	2,491	170,717.58	0.06
80	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.06
81	301382	蜂助手	3,557	135,377.68	0.05
82	301315	威士顿	2,160	127,351.44	0.05
83	301383	天键股份	3,245	120,817.00	0.05
84	301291	C 明阳电	3,483	112,997.87	0.04
85	301395	C 仁信	4,113	109,734.84	0.04
86	301225	恒勃股份	3,058	108,946.84	0.04
87	301488	N 豪恩	2,618	104,144.04	0.04
88	301262	海看股份	3,735	102,804.75	0.04
89	301292	海科新源	4,969	99,330.31	0.04
90	301332	德尔玛	6,590	93,802.06	0.04
91	301232	飞沃科技	1,438	86,945.34	0.03
92	301305	朗坤环境	4,095	84,757.75	0.03
93	301295	C 美硕	2,146	81,770.28	0.03
94	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.03
95	301323	新莱福	1,679	71,963.23	0.03
96	301337	亚华电子	2,057	69,930.62	0.03
97	301261	恒工精密	1,860	68,634.00	0.03
98	301170	锡南科技	1,747	64,591.15	0.02
99	301202	朗威股份	2,209	57,036.38	0.02
100	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.02
101	301376	致欧科技	2,236	52,726.64	0.02
102	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
103	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688599	天合光能	13,536,091.37	5.13
2	002812	恩捷股份	13,456,391.00	5.10

3	300750	宁德时代	13,383,033.00	5.07
4	601012	隆基绿能	10,059,732.20	3.81
5	002459	晶澳科技	8,672,529.00	3.29
6	001301	尚太科技	6,683,547.00	2.53
7	002738	中矿资源	6,611,351.87	2.51
8	002756	永兴材料	6,003,563.55	2.28
9	002460	赣锋锂业	5,937,054.40	2.25
10	002050	三花智控	5,123,275.00	1.94
11	002709	天赐材料	5,065,936.00	1.92
12	002466	天齐锂业	5,006,195.06	1.90
13	002463	沪电股份	4,470,985.00	1.69
14	603993	洛阳钼业	4,391,659.00	1.66
15	688032	禾迈股份	4,310,597.23	1.63
16	600031	三一重工	4,284,112.00	1.62
17	600438	通威股份	4,025,135.00	1.53
18	603338	浙江鼎力	3,987,403.00	1.51
19	002129	TCL 中环	3,919,716.00	1.49
20	601677	明泰铝业	3,766,266.00	1.43

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688599	天合光能	9,038,297.25	3.43
2	601012	隆基绿能	5,649,212.00	2.14
3	002460	赣锋锂业	5,638,112.20	2.14
4	002466	天齐锂业	4,662,649.00	1.77
5	002459	晶澳科技	4,560,545.00	1.73
6	300274	阳光电源	3,624,507.00	1.37
7	601677	明泰铝业	3,184,411.00	1.21
8	688032	禾迈股份	3,133,514.38	1.19
9	300769	德方纳米	3,038,382.00	1.15
10	601898	中煤能源	2,848,268.00	1.08
11	001301	尚太科技	2,747,575.00	1.04
12	002756	永兴材料	2,737,521.06	1.04
13	600031	三一重工	2,633,345.00	1.00
14	300394	天孚通信	2,255,971.00	0.86
15	600426	华鲁恒升	2,009,988.00	0.76
16	600309	万华化学	1,992,489.00	0.76
17	300750	宁德时代	1,881,984.00	0.71
18	300638	广和通	1,785,951.00	0.68
19	601800	中国交建	1,756,489.00	0.67

20	605117	德业股份	1,662,120.00	0.63
----	--------	------	--------------	------

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	264,617,035.76
卖出股票收入（成交）总额	106,938,790.50

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.2 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。



## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中矿资源集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到海淀消防救援支队处罚的情况。

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

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

### 7.12.2

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	44,782.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	181,580.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,098.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	227,461.38

### 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	持有份额	占总份额比	

				例		例
创金合信产业臻选平衡混合 A	1,308	140,112.68	1,933,230.17	1.05%	181,334,150.39	98.95%
创金合信产业臻选平衡混合 C	548	157,814.43	-	-	86,482,305.84	100.00%
合计	1,838	146,762.62	1,933,230.17	0.72%	267,816,456.23	99.28%

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	创金合信产业臻选平衡混合 A	21,579.96	0.01%
	创金合信产业臻选平衡混合 C	10,005.85	0.01%
	合计	31,585.81	0.01%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信产业臻选平衡混合 A	0~10
	创金合信产业臻选平衡混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信产业臻选平衡混合 A	0
	创金合信产业臻选平衡混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信产业臻选平衡混合 A	创金合信产业臻选平衡混合 C
基金合同生效日(2023 年 3 月 1 日)基金份额总额	194,573,683.36	102,806,961.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	104,142.46	352,667.12
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,410,445.26	16,677,323.04
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	183,267,380.56	86,482,305.84

## § 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未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	313,024,778.06	84.74%	134,014.26	91.28%	-
金元证券	2	56,389,462.23	15.26%	12,806.99	8.72%	-

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。

本基金报告期内新增第一创业证券 3 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
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

## 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	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基	公司官网、证券日报、	2023-01-18

	金份额发售公告	中国证监会基金电子披露网站	
2	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
3	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基金合同	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
4	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金托管协议	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
5	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金招募说明书	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
6	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
7	创金合信基金管理有限公司关于创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金提前结束募集的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-13
8	创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
9	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
10	创金合信基金管理有限公司关于旗下创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
11	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
12	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
13	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购(含定期定额投资)及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
14	创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-27

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。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”。截至 2023 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 95 只公募基金，公募管理规模 1161.93 亿元。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信产业臻选平衡混合型证券投资基金 2023 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](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日