

创金合信量化多因子股票型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 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.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	10
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§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.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信量化多因子股票	
基金主代码	002210	
交易代码	002210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 22 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	229,277,493.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	002210	003865
报告期末下属分级基金的份 额总额	192,887,658.12 份	36,389,835.38 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	本基金为股票型基金，股票投资部分占基金资产的比例不低于 80%。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	中证 1000 指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	北京市西城区复兴门内大街 55

	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）	号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518052	100140
法定代表人	钱龙海	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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、创金合信量化多因子股票 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,903,400.34
本期利润	12,254,055.45
加权平均基金份额本期利润	0.0637
本期加权平均净值利润率	3.96%
本期基金份额净值增长率	4.20%
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	109,049,664.51
期末可供分配基金份额利润	0.5654
期末基金资产净值	302,172,899.87
期末基金份额净值	1.5666
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	84.56%

2、创金合信量化多因子股票 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,202,140.80
本期利润	12,613,707.30
加权平均基金份额本期利润	0.1496
本期加权平均净值利润率	9.72%
本期基金份额净值增长率	3.82%
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	17,608,401.98
期末可供分配基金份额利润	0.4839
期末基金资产净值	53,998,237.36
期末基金份额净值	1.4839
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	39.72%

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. 本基金从 2017 年 1 月 6 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 1 月 6 日起存续。

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

创金合信量化多因子股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.96%	0.57%	0.94%	-0.19%	0.02%
过去三个月	-4.37%	0.86%	-3.56%	0.83%	-0.81%	0.03%
过去六个月	4.20%	0.85%	4.64%	0.80%	-0.44%	0.05%
过去一年	-4.97%	1.06%	-4.92%	0.99%	-0.05%	0.07%
过去三年	33.40%	1.27%	4.78%	1.23%	28.62%	0.04%
自基金合同生效起至今	84.56%	1.26%	9.26%	1.30%	75.30%	-0.04%

创金合信量化多因子股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	----------	-------------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.32%	0.96%	0.57%	0.94%	-0.25%	0.02%
过去三个月	-4.55%	0.86%	-3.56%	0.83%	-0.99%	0.03%
过去六个月	3.82%	0.85%	4.64%	0.80%	-0.82%	0.05%
过去一年	-5.66%	1.06%	-4.92%	0.99%	-0.74%	0.07%
过去三年	30.46%	1.27%	4.78%	1.23%	25.68%	0.04%
自基金合同 生效起至今	39.72%	1.30%	-0.85%	1.28%	40.57%	0.02%

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

创金合信量化多因子股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年01月22日-2023年06月30日)



创金合信量化多因子股票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01月06日-2023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 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄小虎	本基金基金经理	2022 年 7 月 29 日	-	5	黄小虎先生，中国国籍，香港城市大学博士。2017 年 12 月加入安信证券股份有限公司，任信息技术中心数据挖掘岗，2018 年 10 月加入大成基金管理有限公司，历任战略发展部助理研究员、数量与指数投资部研究员，2021 年 1 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席量化投资官兼任量化指数与国际部总监	2019 年 7 月 5 日	-	19	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003 年 12 月加入 UNX Inc 任分析师，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015 年 1 月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数与国际

					部总监、基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

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

2、证券从业年限的含义遵从《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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，本基金与管理人管理的其他投资组合构成同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 3 次，本基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

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

一季度楼市小阳春，居民投资和消费信心较好，叠加大语言模型 ChatGPT 兴起，A 股市场整体表现较好，TMT 板块表现突出。二季度受出口和就业下滑影响，地产和消费也陷入

缓慢恢复阶段，经济数据和金融数据不及预期，市场信心有所下降，交易活跃度降低，A 股各宽基指数多数小幅下跌。

2023 年上半年，基金的业绩基准中证 1000 指数表现较好，累计上涨 5.10%。基准指数成份股内，表现较好的几个行业是通信 45.41%、传媒 43.43%、计算机 32.27%，表现较差的几个行业是消费者服务-27.92%、房地产-14.07%、农林牧渔-9.21%。风格方面，价值因子和交易因子整体占优，上半年对组合超额贡献较多的风格因子包括价值因子、波动率因子和流动性因子。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信量化多因子股票 A 基金份额净值为 1.5666 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.20%，同期业绩比较基准收益率为 4.64%；截至本报告期末创金合信量化多因子股票 C 基金份额净值为 1.4839 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.82%，同期业绩比较基准收益率为 4.64%。

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 2023 年下半年，美联储可能继续加息以达到通胀目标，全球风险资产会受到一定的压制。国内方面，当前各项经济数据显示投资端信心不足，需求有所收缩，经济恢复存在一定困难，市场对政策的预期比较强烈。下半年货币政策和财政政策可能发力，未来市场风格和方向还需要关注政策的种类和力度。中长期看，当下主要宽基指数的估值在历史平均水平附近或之下，市场系统性风险不大，仍然以结构性机会为主，板块轮动现象会持续。

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

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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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 2023 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：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	6,129,696.82	12,584,332.81
结算备付金		8,623,018.84	9,978,182.71
存出保证金		684,195.50	886,618.89
交易性金融资产	6.4.7.2	346,549,299.02	451,049,485.81
其中：股票投资		332,443,115.17	438,189,538.18
基金投资		-	-
债券投资		14,106,183.85	12,859,947.63
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		3,924,541.18	5,587,914.17
应收股利		-	-
应收申购款		792,463.54	93,419.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		366,703,214.90	480,179,953.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		5,001,698.64	4,999,463.77
应付清算款		3,764,075.50	2,650,507.89
应付赎回款		334,833.24	225,165.65
应付管理人报酬		442,151.70	663,072.24
应付托管费		73,691.96	110,512.03
应付销售服务费		35,901.01	119,705.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.31	1.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	879,721.31	1,368,121.74
负债合计		10,532,077.67	10,136,550.08
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	229,277,493.50	318,451,058.97
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	126,893,643.73	151,592,344.82
净资产合计		356,171,137.23	470,043,403.79
负债和净资产总计		366,703,214.90	480,179,953.87

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信量化多因子股票 A 份额净值 1.5666 元，基金份额总额 192,887,658.12 份；创金合信量化多因子股票 C 份额净值 1.4839 元，基金份额总额 36,389,835.38 份；总份额合计 229,277,493.50 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		29,336,687.30	-56,095,958.54
1.利息收入		99,306.93	92,650.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	99,306.93	92,650.69
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）		22,279,644.67	-56,790,199.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,392,790.22	-55,780,329.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	437,018.12	120,589.92
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	370,694.35	-3,122,424.41
股利收益	6.4.7.15	4,079,141.98	1,991,964.70
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	6.4.7.16	6,762,221.61	56,244.89

失以“-”号填列)			
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	195,514.09	545,345.57
减:二、营业总支出		4,468,924.55	3,337,489.97
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,264,905.65	2,515,235.68
2.托管费	6.4.10.2.2	544,150.97	419,205.94
3.销售服务费	6.4.10.2.3	482,458.45	297,059.78
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		72,105.58	-
其中:卖出回购金融资产支出		72,105.58	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		2,045.34	0.12
8.其他费用	6.4.7.19	103,258.56	105,988.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		24,867,762.75	-59,433,448.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		24,867,762.75	-59,433,448.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,867,762.75	-59,433,448.51

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期:2023年1月1日至2023年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2023年1月1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)	318,451,058.97	-	151,592,344.82	470,043,403.79
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)	318,451,058.97	-	151,592,344.82	470,043,403.79
三、本期增减变动额(减少以“-”	-89,173,565.47	-	-24,698,701.09	-113,872,266.56

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	24,867,762.75	24,867,762.75
(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)	-89,173,565.47	-	-49,566,463.84	-138,740,029.31
其中: 1.基金申购款	48,176,294.54	-	27,991,996.50	76,168,291.04
2.基金赎回款	-137,349,860.01	-	-77,558,460.34	-214,908,320.35
(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)	229,277,493.50	-	126,893,643.73	356,171,137.23
项目	上年度可比期间 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)	213,613,647.09	-	230,809,902.83	444,423,549.92
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)	213,613,647.09	-	230,809,902.83	444,423,549.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,837,789.15	-	-91,440,595.98	-156,278,385.13
(一)、综合收益总额	-	-	-59,433,448.51	-59,433,448.51
(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)	-64,837,789.15	-	-32,007,147.47	-96,844,936.62

其中：1.基金申购款	99,596,324.95	-	88,235,939.26	187,832,264.21
2.基金赎回款	-164,434,114.10	-	-120,243,086.73	-284,677,200.83
(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）	148,775,857.94	-	139,369,306.85	288,145,164.79

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

创金合信量化多因子股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2238 号《关于准予创金合信量化多因子股票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《创金合信量化多因子股票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 202,600,123.85 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(2016)第 086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 202,639,215.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 39,091.62 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《创金合信量化多因子股票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《创金合信量化多因子股票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、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(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。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率(税后)×10%。

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》、《创金合信量化多因子股票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 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金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	6,129,696.82
等于：本金	6,128,977.95
加：应计利息	718.87
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	6,129,696.82

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	346,021,653.80	-	332,443,115.17	-13,578,538.63	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,921,878.00	148,183.85	14,106,183.85	36,122.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,921,878.00	148,183.85	14,106,183.85	36,122.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	359,943,531.80	148,183.85	346,549,299.02	-13,542,416.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,888,880.00	-	-	-
--股指期货	3,888,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,888,880.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2309	IM2309	3.00	3,921,840.00	32,960.00
合计				32,960.00
减：可抵销期货暂收款				32,960.00
净额				-

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	23.79

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	786,094.96
其中：交易所市场	786,094.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,602.56
合计	879,721.31

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信量化多因子股票 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,889,599.96	200,889,599.96
本期申购	18,464,157.52	18,464,157.52
本期赎回（以“-”号填列）	-26,466,099.36	-26,466,099.36
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	192,887,658.12	192,887,658.12

创金合信量化多因子股票 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,561,459.01	117,561,459.01
本期申购	29,712,137.02	29,712,137.02
本期赎回（以“-”号填列）	-110,883,760.65	-110,883,760.65
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	36,389,835.38	36,389,835.38

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

创金合信量化多因子股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	104,004,196.60	-2,883,197.90	101,120,998.70
本期利润	8,903,400.34	3,350,655.11	12,254,055.45
本期基金份额交易产生的变动数	-3,857,932.43	-231,879.97	-4,089,812.40
其中：基金申购款	10,937,469.02	613,641.43	11,551,110.45
基金赎回款	-14,795,401.45	-845,521.40	-15,640,922.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,049,664.51	235,577.24	109,285,241.75

创金合信量化多因子股票 C			
---------------	--	--	--

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,225,574.27	-1,754,228.15	50,471,346.12
本期利润	9,202,140.80	3,411,566.50	12,613,707.30
本期基金份额交易产生的变动数	-43,817,847.21	-1,658,804.23	-45,476,651.44
其中：基金申购款	15,211,350.95	1,229,535.10	16,440,886.05
基金赎回款	-59,029,198.16	-2,888,339.33	-61,917,537.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,609,867.86	-1,465.88	17,608,401.98

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,732.18
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	76,959.19
其他	1,615.56
合计	99,306.93

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,392,790.22
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	17,392,790.22

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,752,509,024.03
减：卖出股票成本总额	2,729,813,019.37
减：交易费用	5,303,214.44
买卖股票差价收入	17,392,790.22

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

债券投资收益——利息收入	108,228.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	328,789.44
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	437,018.12

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,544,031.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,956,806.00
减：应计利息总额	258,358.68
减：交易费用	77.49
买卖债券差价收入	328,789.44

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
期货投资	370,694.35

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,079,141.98
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	4,079,141.98

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	6,710,821.61
——股票投资	6,661,178.45
——债券投资	49,643.16
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	51,400.00
——权证投资	-
——期货投资	51,400.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	6,762,221.61

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	193,795.55
转换费收入	1,718.54
合计	195,514.09

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	356.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	103,258.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,264,905.65	2,515,235.68
其中：支付销售机构的客户维护费	891,882.11	927,444.01

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	544,150.97	419,205.94

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C	合计
创金合信直销	-	242,529.20	242,529.20
第一创业证券	-	96.02	96.02
中国工商银行	-	3,383.71	3,383.71
合计	-	246,008.93	246,008.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C	合计
创金合信直销	-	154,636.85	154,636.85
第一创业证券	-	-	-
中国工商银行	-	3,168.93	3,168.93
合计	-	157,805.78	157,805.78

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 0.75% 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：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.75% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	6,129,696.82	20,732.18	15,671,844.59	39,466.72

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（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	4,676	124,755.68	124,755.68	-
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	5,241	104,767.59	104,767.59	-
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	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
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	2,658	68,629.56	68,629.56	-
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	1,775	65,497.50	65,497.50	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	23.60	64.67	522	12,319.20	33,757.74	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	5.69	5.41	4,948	28,154.12	26,768.68	-
688472	阿特斯	2023 年	1-6 个	科创板	11.10	17.04	1,565	17,371.50	26,667.60	-

		6月2日	月(含)	打新限售						
301293	三博脑科	2023年4月25日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688531	日联科技	2023年3月24日	1-6个月(含)	科创板打新限售	152.38	135.97	162	24,685.56	22,027.14	-
301307	美利信	2023年4月14日	1-6个月(含)	创业板打新限售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
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	326	21,933.28	21,330.18	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.80	22.32	867	23,235.60	19,351.44	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	1-6个月(含)	科创板打新限售	75.00	90.76	211	15,825.00	19,150.36	-
688146	中船特气	2023年4月13日	1-6个月(含)	科创板打新限售	36.15	38.13	498	18,002.70	18,988.74	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	1-6个月(含)	科创板打新限售	39.99	36.71	509	20,354.91	18,685.39	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688576	西山科技	2023年5月30日	1-6个月(含)	科创板打新限售	135.80	120.41	149	20,234.20	17,941.09	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	1-6个月(含)	科创板打新限售	21.17	23.50	748	15,835.16	17,578.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	科创板打新限售	26.74	40.68	423	11,311.02	17,207.64	-
688562	航天软件	2023年5月15日	1-6个月(含)	科创板打新限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	1-6个月(含)	科创板打新限售	245.56	122.11	129	21,363.72	15,752.19	-

688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	12.10	12.07	1,279	15,475.90	15,437.53	-
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	1,122	16,616.82	15,405.06	-
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	423	19,525.68	15,109.56	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
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	465	17,730.45	14,428.95	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	125.8 0	118.0 3	121	15,221.80	14,281.63	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
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	520	13,873.60	13,873.60	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
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	698	17,624.50	13,743.62	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.88	21.02	644	7,650.72	13,536.88	-
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	408	9,710.40	13,398.72	-
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	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

		日		售						
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	11.18	14.59	877	9,804.86	12,795.43	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	131.1 1	53.24	237	20,715.38	12,617.88	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	14.16	16.21	770	10,903.20	12,481.70	-
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	489	14,777.58	12,469.50	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	10.68	12.34	988	10,551.84	12,191.92	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	43.67	53.05	229	10,000.43	12,148.45	-
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	583	11,654.17	11,654.17	-
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	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
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	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023 年	1-6 个	创业板	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

		6月26日	月(含)	打新限售						
601061	中信金属	2023年3月30日	1-6个月(含)	新股锁定	6.58	7.58	1,327	8,731.66	10,058.66	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	1-6个月(含)	科创板打新限售	30.26	25.33	392	11,861.92	9,929.36	-
688479	友车科技	2023年5月4日	1-6个月(含)	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
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	165	11,962.50	9,639.30	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	1-6个月(含)	科创板打新限售	25.28	29.87	305	7,710.40	9,110.35	-
301386	未来电器	2023年3月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
688429	时创能源	2023年6月20日	1-6个月(含)	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	1-6个月(含)	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
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	220	8,593.20	8,659.20	-
688623	双元科技	2023年5月31日	1-6个月(含)	科创板打新限售	125.88	86.79	99	12,462.12	8,592.21	-
301281	科源制药	2023年3月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	1-6个月(含)	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	34.00	34.93	231	7,854.00	8,068.83	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	1-6个月(含)	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

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	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	1-6 个 月(含)	创业板 打新限 售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	科创板 打新限 售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
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	296	7,642.72	7,642.72	-
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	198	7,306.20	7,306.20	-
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	232	7,563.20	7,045.84	-
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	-
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	297	7,324.02	6,685.47	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	11.66	12.26	512	5,969.92	6,277.12	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	10.36	11.84	508	5,262.88	6,014.72	-
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	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
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	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

		日								
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
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	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月 内(含)	新债未 上市	100.0 0	100.0 1	9,606	960,600.00	960,680.01	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、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

截至本报告期 2023 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 5,001,698.64 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持

有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,145,503.84	12,599,588.42
合计	13,145,503.84	12,599,588.42

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券以及无第三方评级机构短期债项评级的其他债券。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	960,680.01	260,359.21
未评级	-	-
合计	960,680.01	260,359.21

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 5,002,972.60 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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 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	6,129,696.82	-	-	-	6,129,696.82
结算备付金	8,623,018.84	-	-	-	8,623,018.84
存出保证金	684,195.50	-	-	-	684,195.50
交易性金融资产	13,145,503.84	-	960,680.01	332,443,115.17	346,549,299.02
应收申购款	-	-	-	792,463.54	792,463.54
应收清算款	-	-	-	3,924,541.18	3,924,541.18
资产总计	28,582,415.00	-	960,680.01	337,160,119.89	366,703,214.90
负债					
卖出回购金融资产款	5,001,698.64	-	-	-	5,001,698.64
应付赎回款	-	-	-	334,833.24	334,833.24
应付管理人报酬	-	-	-	442,151.70	442,151.70
应付托管费	-	-	-	73,691.96	73,691.96
应付销售服务费	-	-	-	35,901.01	35,901.01
应交税费	-	-	-	4.31	4.31
应付清算款	-	-	-	3,764,075.50	3,764,075.50
其他负债	-	-	-	879,721.31	879,721.31
负债总计	5,001,698.64	-	-	5,530,379.03	10,532,077.67
利率敏感度缺口	23,580,716.36	-	960,680.01	331,629,740.86	356,171,137.23
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,584,332.81	-	-	-	12,584,332.81
结算备付金	9,978,182.71	-	-	-	9,978,182.71

存出保证金	886,618.89	-	-	-	886,618.89
交易性金融资产	12,599,588.42	-	260,359.21	438,189,538.18	451,049,485.81
应收申购款	-	-	-	93,419.48	93,419.48
应收清算款	-	-	-	5,587,914.17	5,587,914.17
资产总计	36,048,722.83	-	260,359.21	443,870,871.83	480,179,953.87
负债					
卖出回购金融资产款	4,999,463.77	-	-	-	4,999,463.77
应付赎回款	-	-	-	225,165.65	225,165.65
应付管理人报酬	-	-	-	663,072.24	663,072.24
应付托管费	-	-	-	110,512.03	110,512.03
应付销售服务费	-	-	-	119,705.15	119,705.15
应交税费	-	-	-	1.61	1.61
应付清算款	-	-	-	2,650,507.89	2,650,507.89
其他负债	-	-	-	1,368,121.74	1,368,121.74
负债总计	4,999,463.77	-	-	5,137,086.31	10,136,550.08
利率敏感度缺口	31,049,259.06	-	260,359.21	438,733,785.52	470,043,403.79

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-10,337.13	-1,274.60
2.市场利率平行下降25个基点	10,370.75	1,278.10	

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	332,443,115.17	93.34	438,189,538.18	93.22
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	332,443,115.17	93.34	438,189,538.18	93.22

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）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	16,966,234.38	22,849,393.47
2.业绩比较基准下降 5%	-16,966,234.38	-22,849,393.47	

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	330,911,567.92
第二层次	14,690,959.91
第三层次	946,771.19
合计	346,549,299.02

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(2022 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 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	332,443,115.17	90.66
	其中：股票	332,443,115.17	90.66
2	固定收益投资	14,106,183.85	3.85
	其中：债券	14,106,183.85	3.85
	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	14,752,715.66	4.02
7	其他资产	5,401,200.22	1.47
8	合计	366,703,214.90	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	467,711.40	0.13
B	采矿业	2,103,185.00	0.59
C	制造业	214,686,910.98	60.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,973,713.47	1.68
E	建筑业	4,601,543.63	1.29
F	批发和零售业	16,384,862.76	4.60
G	交通运输、仓储和邮政业	771,713.00	0.22
H	住宿和餐饮业	3,114,060.00	0.87
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,984,219.77	16.28
J	金融业	2,696,717.00	0.76
K	房地产业	5,590,134.50	1.57
L	租赁和商务服务业	6,305,052.00	1.77
M	科学研究和技术服务业	1,554,491.18	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	3,325,573.62	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	6,637,059.00	1.86
S	综合	222,385.00	0.06
	合计	332,443,115.17	93.34

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	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

				(元)	净值比例 (%)
1	002467	二六三	923,300	4,588,801.00	1.29
2	001696	宗申动力	637,579	4,514,059.32	1.27
3	002950	奥美医疗	427,100	4,433,298.00	1.24
4	000555	神州信息	360,000	4,428,000.00	1.24
5	600510	黑牡丹	722,700	4,386,789.00	1.23
6	688005	容百科技	81,102	4,381,130.04	1.23
7	600037	歌华有线	520,101	4,322,039.31	1.21
8	600535	天士力	294,800	4,277,548.00	1.20
9	300377	赢时胜	527,478	4,272,571.80	1.20
10	300919	中伟股份	70,750	4,262,687.50	1.20
11	002048	宁波华翔	314,400	4,212,960.00	1.18
12	605358	立昂微	114,600	4,209,258.00	1.18
13	600850	电科数字	177,800	4,194,302.00	1.18
14	000060	中金岭南	880,700	4,183,325.00	1.17
15	000785	居然之家	1,097,400	4,181,094.00	1.17
16	002273	水晶光电	349,100	4,168,254.00	1.17
17	002233	塔牌集团	539,000	4,161,080.00	1.17
18	300177	中海达	611,300	4,138,501.00	1.16
19	600986	浙文互联	646,000	4,134,400.00	1.16
20	002106	莱宝高科	484,800	4,120,800.00	1.16
21	600511	国药股份	103,800	4,032,630.00	1.13
22	300260	新莱应材	101,080	3,994,681.60	1.12
23	002583	海能达	683,600	3,971,716.00	1.12
24	002238	天威视讯	571,700	3,961,881.00	1.11
25	002032	苏泊尔	79,000	3,950,000.00	1.11
26	002636	金安国纪	423,400	3,907,982.00	1.10
27	002695	煌上煌	330,800	3,536,252.00	0.99
28	603368	柳药股份	141,900	3,506,349.00	0.98
29	601615	明阳智能	206,600	3,487,408.00	0.98
30	002421	达实智能	987,390	3,475,612.80	0.98
31	002916	深南电路	45,800	3,451,946.00	0.97
32	601766	中国中车	521,000	3,386,500.00	0.95
33	603421	鼎信通讯	308,740	3,226,333.00	0.91
34	002148	北纬科技	520,400	3,174,440.00	0.89
35	603160	汇顶科技	67,800	3,135,750.00	0.88
36	603136	天目湖	120,800	3,116,640.00	0.88
37	601007	金陵饭店	365,500	3,114,060.00	0.87
38	601139	深圳燃气	426,300	3,107,727.00	0.87
39	600478	科力远	428,200	3,057,348.00	0.86
40	603185	上机数控	41,000	3,056,550.00	0.86
41	600143	金发科技	342,800	2,992,644.00	0.84

42	002283	天润工业	461,000	2,959,620.00	0.83
43	000811	冰轮环境	182,300	2,873,048.00	0.81
44	603989	艾华集团	121,400	2,556,684.00	0.72
45	002237	恒邦股份	228,800	2,491,632.00	0.70
46	603719	良品铺子	98,900	2,473,489.00	0.69
47	600682	南京新百	300,600	2,407,806.00	0.68
48	603883	老百姓	79,322	2,367,761.70	0.66
49	300531	优博讯	167,300	2,365,622.00	0.66
50	600502	安徽建工	441,800	2,332,704.00	0.65
51	600783	鲁信创投	180,100	2,328,693.00	0.65
52	300762	上海瀚讯	186,000	2,189,220.00	0.61
53	601567	三星医疗	171,100	2,160,993.00	0.61
54	002085	万丰奥威	303,400	2,102,562.00	0.59
55	688561	奇安信	40,100	2,077,581.00	0.58
56	002746	仙坛股份	263,400	2,075,592.00	0.58
57	000156	华数传媒	233,100	2,027,970.00	0.57
58	300645	正元智慧	74,000	2,021,680.00	0.57
59	603833	欧派家居	21,000	2,011,800.00	0.56
60	002063	远光软件	230,400	1,999,872.00	0.56
61	601126	四方股份	130,600	1,983,814.00	0.56
62	603612	索通发展	111,735	1,936,367.55	0.54
63	000607	华媒控股	378,200	1,906,128.00	0.54
64	600285	羚锐制药	114,100	1,832,446.00	0.51
65	600803	新奥股份	95,500	1,812,590.00	0.51
66	300791	仙乐健康	62,300	1,809,192.00	0.51
67	688499	利元亨	27,713	1,760,329.76	0.49
68	688233	神工股份	55,024	1,737,657.92	0.49
69	002435	长江健康	355,000	1,728,850.00	0.49
70	600201	生物股份	174,600	1,660,446.00	0.47
71	002446	盛路通信	175,700	1,660,365.00	0.47
72	002126	银轮股份	93,700	1,658,490.00	0.47
73	603416	信捷电气	38,400	1,586,304.00	0.45
74	300158	振东制药	270,100	1,547,673.00	0.43
75	000913	钱江摩托	82,800	1,509,444.00	0.42
76	603757	大元泵业	49,800	1,486,032.00	0.42
77	002815	崇达技术	116,700	1,452,915.00	0.41
78	600801	华新水泥	117,300	1,448,655.00	0.41
79	002869	金溢科技	64,500	1,417,710.00	0.40
80	601928	凤凰传媒	116,000	1,322,400.00	0.37
81	603010	万盛股份	119,500	1,298,965.00	0.36
82	301171	易点天下	57,200	1,264,120.00	0.35
83	002150	通润装备	74,200	1,260,658.00	0.35
84	600557	康缘药业	45,700	1,254,922.00	0.35

85	300662	科锐国际	35,200	1,245,024.00	0.35
86	603528	多伦科技	162,000	1,237,680.00	0.35
87	600707	彩虹股份	257,600	1,226,176.00	0.34
88	600184	光电股份	92,615	1,216,034.95	0.34
89	600284	浦东建设	196,300	1,201,356.00	0.34
90	600637	东方明珠	151,100	1,181,602.00	0.33
91	603171	税友股份	29,000	1,159,420.00	0.33
92	000823	超声电子	119,200	1,130,016.00	0.32
93	300850	新强联	29,600	1,106,448.00	0.31
94	603043	广州酒家	38,400	1,085,184.00	0.30
95	003007	直真科技	39,900	1,029,021.00	0.29
96	002314	南山控股	301,200	993,960.00	0.28
97	601717	郑煤机	79,800	993,510.00	0.28
98	300439	美康生物	85,500	967,005.00	0.27
99	600073	上海梅林	129,300	943,890.00	0.27
100	300941	创识科技	45,600	927,504.00	0.26
101	002955	鸿合科技	38,000	894,900.00	0.25
102	000860	顺鑫农业	26,300	886,047.00	0.25
103	300242	佳云科技	255,800	882,510.00	0.25
104	603530	神马电力	55,600	864,580.00	0.24
105	002139	拓邦股份	64,300	839,115.00	0.24
106	000968	蓝焰控股	108,700	821,772.00	0.23
107	300298	三诺生物	30,000	811,200.00	0.23
108	000948	南天信息	47,400	801,060.00	0.22
109	002250	联化科技	73,600	769,856.00	0.22
110	600576	祥源文化	91,100	726,067.00	0.20
111	600812	华北制药	126,200	705,458.00	0.20
112	002416	爱施德	95,000	701,100.00	0.20
113	002053	云南能投	61,900	694,518.00	0.19
114	688578	艾力斯	25,306	681,996.70	0.19
115	600582	天地科技	115,400	672,782.00	0.19
116	300559	佳发教育	40,700	671,550.00	0.19
117	605167	利柏特	69,100	668,888.00	0.19
118	688556	高测股份	12,548	666,800.72	0.19
119	600583	海油工程	112,700	659,295.00	0.19
120	603179	新泉股份	15,000	658,350.00	0.18
121	600746	江苏索普	99,300	648,429.00	0.18
122	002484	江海股份	29,700	632,313.00	0.18
123	002907	华森制药	41,300	628,586.00	0.18
124	002312	川发龙蟒	76,900	625,197.00	0.18
125	002859	洁美科技	22,360	619,372.00	0.17
126	601222	林洋能源	73,800	604,422.00	0.17
127	600623	华谊集团	96,500	601,195.00	0.17

128	600818	中路股份	27,700	586,132.00	0.16
129	688135	利扬芯片	25,787	565,508.91	0.16
130	300820	英杰电气	6,800	560,184.00	0.16
131	603232	格尔软件	38,500	559,790.00	0.16
132	600662	外服控股	94,100	538,252.00	0.15
133	600761	安徽合力	27,000	538,110.00	0.15
134	002115	三维通信	80,600	525,512.00	0.15
135	002332	仙琚制药	39,500	523,375.00	0.15
136	601677	明泰铝业	37,600	521,888.00	0.15
137	603396	金辰股份	7,900	518,240.00	0.15
138	600572	康恩贝	75,600	517,860.00	0.15
139	688139	海尔生物	10,053	517,427.91	0.15
140	002449	国星光电	58,200	517,398.00	0.15
141	000881	中广核技	62,300	512,729.00	0.14
142	002675	东诚药业	33,500	492,785.00	0.14
143	600273	嘉化能源	51,800	487,956.00	0.14
144	600587	新华医疗	13,800	487,554.00	0.14
145	603279	景津装备	15,300	479,808.00	0.13
146	300379	东方通	23,300	479,281.00	0.13
147	002662	京威股份	143,500	477,855.00	0.13
148	300183	东软载波	28,900	477,139.00	0.13
149	603063	禾望电气	15,500	476,625.00	0.13
150	002518	科士达	11,800	472,118.00	0.13
151	600483	福能股份	39,700	458,535.00	0.13
152	603027	千禾味业	21,300	449,856.00	0.13
153	688639	华恒生物	4,910	444,256.80	0.12
154	002837	英维克	14,800	443,112.00	0.12
155	002324	普利特	31,000	442,370.00	0.12
156	300101	振芯科技	22,800	442,092.00	0.12
157	600055	万东医疗	21,000	437,430.00	0.12
158	002123	梦网科技	32,700	434,583.00	0.12
159	000030	富奥股份	84,700	426,888.00	0.12
160	300226	上海钢联	13,120	425,088.00	0.12
161	600378	昊华科技	11,200	421,568.00	0.12
162	600933	爱柯迪	18,100	421,549.00	0.12
163	300035	中科电气	35,000	420,700.00	0.12
164	300034	钢研高纳	10,551	415,603.89	0.12
165	002597	金禾实业	17,350	409,460.00	0.11
166	002100	天康生物	49,200	405,900.00	0.11
167	600562	国睿科技	25,000	405,000.00	0.11
168	000813	德展健康	134,200	394,548.00	0.11
169	002020	京新药业	30,700	393,574.00	0.11
170	603338	浙江鼎力	7,000	392,070.00	0.11

171	600206	有研新材	29,740	390,783.60	0.11
172	002866	传艺科技	13,600	385,424.00	0.11
173	002737	葵花药业	15,600	379,704.00	0.11
174	300203	聚光科技	18,400	372,968.00	0.10
175	300910	瑞丰新材	7,410	372,723.00	0.10
176	601137	博威合金	23,800	370,328.00	0.10
177	601519	大智慧	51,400	368,024.00	0.10
178	600420	国药现代	32,500	366,925.00	0.10
179	300398	飞凯材料	21,300	366,147.00	0.10
180	603306	华懋科技	12,600	365,652.00	0.10
181	600990	四创电子	11,500	363,860.00	0.10
182	603505	金石资源	15,520	362,392.00	0.10
183	002541	鸿路钢构	12,500	360,125.00	0.10
184	300855	图南股份	10,170	359,204.40	0.10
185	000650	仁和药业	58,300	357,962.00	0.10
186	600720	祁连山	31,300	355,881.00	0.10
187	600373	中文传媒	26,700	355,644.00	0.10
188	002216	三全食品	22,600	352,108.00	0.10
189	300457	赢合科技	19,900	351,434.00	0.10
190	000969	安泰科技	36,800	348,496.00	0.10
191	688007	光峰科技	16,680	347,778.00	0.10
192	688559	海目星	7,353	345,664.53	0.10
193	300323	华灿光电	50,000	342,500.00	0.10
194	000657	中钨高新	35,340	342,444.60	0.10
195	002051	中工国际	28,700	342,391.00	0.10
196	000915	华特达因	9,600	338,784.00	0.10
197	002171	楚江新材	47,500	338,200.00	0.09
198	300587	天铁股份	43,800	337,260.00	0.09
199	600729	重庆百货	10,700	336,408.00	0.09
200	688033	天宜上佳	17,467	333,969.04	0.09
201	300109	新开源	13,300	330,771.00	0.09
202	601369	陕鼓动力	35,900	327,049.00	0.09
203	600210	紫江企业	61,200	325,584.00	0.09
204	603678	火炬电子	9,400	323,924.00	0.09
205	002390	信邦制药	72,200	319,846.00	0.09
206	603639	海利尔	17,800	318,976.00	0.09
207	603997	继峰股份	22,300	318,890.00	0.09
208	300772	运达股份	24,400	314,272.00	0.09
209	603801	志邦家居	9,500	313,690.00	0.09
210	688055	龙腾光电	76,778	311,718.68	0.09
211	000875	吉电股份	57,600	310,464.00	0.09
212	300049	福瑞股份	13,000	299,000.00	0.08
213	603466	风语筑	21,500	298,850.00	0.08

214	002967	广电计量	14,717	295,664.53	0.08
215	300352	北信源	58,500	294,840.00	0.08
216	300596	利安隆	7,100	288,757.00	0.08
217	688278	特宝生物	6,374	279,882.34	0.08
218	603766	隆鑫通用	52,600	277,728.00	0.08
219	300608	思特奇	28,700	277,242.00	0.08
220	002158	汉钟精机	11,100	277,056.00	0.08
221	002498	汉缆股份	68,500	274,685.00	0.08
222	603595	东尼电子	6,400	274,048.00	0.08
223	000032	深桑达 A	8,300	273,070.00	0.08
224	300633	开立医疗	5,000	272,500.00	0.08
225	688202	美迪西	3,133	267,088.25	0.07
226	300054	鼎龙股份	10,400	257,192.00	0.07
227	603906	龙蟠科技	14,100	255,915.00	0.07
228	300119	瑞普生物	14,100	250,980.00	0.07
229	000862	银星能源	32,500	248,950.00	0.07
230	600742	一汽富维	30,300	248,157.00	0.07
231	605507	国邦医药	11,652	247,838.04	0.07
232	603919	金徽酒	10,511	246,798.28	0.07
233	002635	安洁科技	17,700	244,260.00	0.07
234	600075	新疆天业	51,700	243,507.00	0.07
235	600108	亚盛集团	78,100	235,862.00	0.07
236	002550	千红制药	45,600	235,296.00	0.07
237	300055	万邦达	32,600	234,720.00	0.07
238	603187	海容冷链	11,740	234,682.60	0.07
239	000557	西部创业	44,300	233,461.00	0.07
240	300231	银信科技	26,200	233,442.00	0.07
241	688100	威胜信息	7,792	232,279.52	0.07
242	300761	立华股份	12,580	231,849.40	0.07
243	300470	中密控股	5,000	231,100.00	0.06
244	603733	仙鹤股份	11,060	230,601.00	0.06
245	600789	鲁抗医药	35,900	230,478.00	0.06
246	601028	玉龙股份	21,200	227,900.00	0.06
247	301015	百洋医药	8,100	224,856.00	0.06
248	600770	综艺股份	39,500	222,385.00	0.06
249	600456	宝钛股份	6,500	219,960.00	0.06
250	002929	润建股份	4,900	212,709.00	0.06
251	300382	斯莱克	16,000	211,040.00	0.06
252	300735	光弘科技	19,700	210,790.00	0.06
253	000718	苏宁环球	76,500	208,845.00	0.06
254	000498	山东路桥	32,500	208,650.00	0.06
255	001270	铖昌科技	2,380	207,774.00	0.06
256	688389	普门科技	8,773	206,077.77	0.06

257	000061	农产品	34,300	205,457.00	0.06
258	603301	振德医疗	6,900	204,378.00	0.06
259	688676	金盘科技	6,638	201,065.02	0.06
260	603387	基蛋生物	15,500	199,795.00	0.06
261	600308	华泰股份	53,220	197,978.40	0.06
262	300653	正海生物	5,700	196,023.00	0.06
263	688576	西山科技	1,482	195,310.07	0.05
264	300767	震安科技	7,600	192,736.00	0.05
265	002367	康力电梯	20,900	190,817.00	0.05
266	002549	凯美特气	16,300	187,450.00	0.05
267	688311	盟升电子	2,680	187,439.20	0.05
268	002645	华宏科技	15,200	186,352.00	0.05
269	603229	奥翔药业	8,700	182,526.00	0.05
270	300887	谱尼测试	4,532	179,376.56	0.05
271	300679	电连技术	5,300	175,165.00	0.05
272	605020	永和股份	6,760	174,475.60	0.05
273	688085	三友医疗	6,591	173,079.66	0.05
274	600050	中国联通	35,600	170,880.00	0.05
275	002768	国恩股份	7,000	169,330.00	0.05
276	603609	禾丰股份	18,600	169,260.00	0.05
277	002481	双塔食品	37,500	167,250.00	0.05
278	300440	运达科技	23,600	166,852.00	0.05
279	603283	赛腾股份	3,500	155,750.00	0.04
280	601700	风范股份	29,100	154,521.00	0.04
281	688660	电气风电	27,308	152,105.56	0.04
282	002990	盛视科技	4,100	150,880.00	0.04
283	000550	江铃汽车	10,700	148,088.00	0.04
284	600338	西藏珠峰	8,000	146,080.00	0.04
285	002664	信质集团	10,200	143,616.00	0.04
286	002204	大连重工	27,900	143,406.00	0.04
287	301395	C 仁信	5,196	138,629.28	0.04
288	603297	永新光学	1,700	135,830.00	0.04
289	300554	三超新材	6,500	135,395.00	0.04
290	301322	绿通科技	2,357	131,655.88	0.04
291	688621	阳光诺和	2,227	130,992.14	0.04
292	002651	利君股份	15,900	123,543.00	0.03
293	688127	蓝特光学	6,890	121,470.70	0.03
294	002567	唐人神	18,200	121,030.00	0.03
295	301339	通行宝	4,800	120,624.00	0.03
296	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
297	600271	航天信息	8,500	116,365.00	0.03
298	688711	宏微科技	1,950	113,763.00	0.03
299	000603	盛达资源	9,400	113,646.00	0.03

300	300821	东岳硅材	11,200	109,088.00	0.03
301	301488	N 豪恩	2,618	104,144.04	0.03
302	600618	氯碱化工	11,300	101,361.00	0.03
303	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.03
304	605008	长鸿高科	6,600	94,116.00	0.03
305	000058	深赛格	15,000	92,700.00	0.03
306	600062	华润双鹤	5,000	87,100.00	0.02
307	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
308	301202	朗威股份	2,954	76,272.28	0.02
309	600312	平高电气	6,100	75,579.00	0.02
310	688091	上海谊众	1,006	74,071.78	0.02
311	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
312	603071	物产环能	3,700	61,383.00	0.02
313	601888	中国中免	500	55,265.00	0.02
314	603960	克来机电	2,800	52,220.00	0.01
315	603298	杭叉集团	2,100	49,455.00	0.01
316	688062	迈威生物	2,250	48,442.50	0.01
317	002987	京北方	2,000	43,840.00	0.01
318	002017	东信和平	3,120	40,903.20	0.01
319	300872	天阳科技	2,600	40,404.00	0.01
320	600389	江山股份	1,640	38,950.00	0.01
321	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
322	688361	中科飞测	522	33,757.74	0.01
323	688469	中芯集成	4,948	26,768.68	0.01
324	688472	阿特斯	1,565	26,667.60	0.01
325	688050	爱博医疗	124	25,460.92	0.01
326	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
327	688531	日联科技	162	22,027.14	0.01
328	301307	美利信	687	21,887.82	0.01
329	301310	鑫宏业	326	21,330.18	0.01
330	301303	真兰仪表	867	19,351.44	0.01
331	688458	美芯晟	211	19,150.36	0.01
332	688146	中船特气	498	18,988.74	0.01
333	688484	南芯科技	509	18,685.39	0.01
334	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
335	688552	航天南湖	748	17,578.00	0.00
336	688582	芯动联科	423	17,207.64	0.00
337	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
338	688507	索辰科技	129	15,752.19	0.00
339	688352	颀中科技	1,279	15,437.53	0.00
340	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
341	301383	天键股份	430	15,371.36	0.00
342	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00

343	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
344	301291	C 明阳电	465	14,428.95	0.00
345	688581	安杰思	121	14,281.63	0.00
346	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
347	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
348	301305	朗坤环境	698	13,743.62	0.00
349	001287	中电港	644	13,536.88	0.00
350	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
351	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
352	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
353	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
354	688593	新相微	877	12,795.43	0.00
355	688334	西高院	770	12,481.70	0.00
356	301262	海看股份	489	12,469.50	0.00
357	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
358	688620	安凯微	988	12,191.92	0.00
359	688543	国科军工	229	12,148.45	0.00
360	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
361	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
362	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
363	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
364	603309	维力医疗	700	10,829.00	0.00
365	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
366	601061	中信金属	1,327	10,058.66	0.00
367	688570	天玛智控	392	9,929.36	0.00
368	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
369	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
370	688631	莱斯信息	305	9,110.35	0.00
371	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
372	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
373	301323	新莱福	220	8,659.20	0.00
374	688623	二元科技	99	8,592.21	0.00
375	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
376	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
377	301170	锡南科技	231	8,068.83	0.00
378	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
379	301295	C 美硕	215	7,755.05	0.00
380	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
381	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
382	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
383	301376	致欧科技	297	6,685.47	0.00
384	601133	柏诚股份	512	6,277.12	0.00
385	601065	江盐集团	508	6,014.72	0.00

386	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
387	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
388	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
389	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
390	603916	苏博特	200	2,648.00	0.00
391	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
392	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
393	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
394	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
395	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
396	000029	深深房 A	50	540.50	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	001696	宗申动力	16,221,246.51	3.45
2	002081	金螳螂	15,144,773.13	3.22
3	300098	高新兴	13,076,271.00	2.78
4	300377	赢时胜	12,545,583.38	2.67
5	002106	莱宝高科	12,402,900.01	2.64
6	601689	拓普集团	11,439,562.15	2.43
7	002916	深南电路	10,828,380.00	2.30
8	603118	共进股份	10,789,256.71	2.30
9	688733	壹石通	10,670,332.29	2.27
10	600763	通策医疗	10,581,329.24	2.25
11	002017	东信和平	10,493,891.00	2.23
12	300957	贝泰妮	10,453,260.19	2.22
13	002636	金安国纪	10,062,957.00	2.14
14	000823	超声电子	9,804,356.00	2.09
15	002967	广电计量	9,643,130.11	2.05
16	002421	达实智能	9,520,070.00	2.03
17	601139	深圳燃气	9,495,711.00	2.02
18	600184	光电股份	9,283,406.50	1.98
19	300645	正元智慧	9,197,936.00	1.96
20	002773	康弘药业	9,185,922.00	1.95

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	占期初基金资产
----	------	------	---------	---------

			额	净值比例 (%)
1	002081	金螳螂	15,139,996.94	3.22
2	300098	高新兴	14,004,349.00	2.98
3	300765	新诺威	13,994,132.20	2.98
4	603118	共进股份	12,681,845.80	2.70
5	601689	拓普集团	12,607,258.92	2.68
6	001696	宗申动力	11,693,016.60	2.49
7	603313	梦百合	11,372,922.20	2.42
8	603298	杭叉集团	10,998,381.62	2.34
9	002017	东信和平	10,961,525.97	2.33
10	002249	大洋电机	10,641,096.65	2.26
11	002773	康弘药业	10,160,641.00	2.16
12	300957	贝泰妮	10,057,444.00	2.14
13	002967	广电计量	9,729,806.64	2.07
14	688733	壹石通	9,704,697.04	2.06
15	600763	通策医疗	9,689,083.82	2.06
16	300114	中航电测	9,635,188.28	2.05
17	600917	重庆燃气	9,389,423.60	2.00
18	688127	蓝特光学	9,358,837.92	1.99
19	601799	星宇股份	9,255,608.40	1.97
20	300602	飞荣达	9,039,425.74	1.92

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	2,617,405,417.91
卖出股票收入（成交）总额	2,752,509,024.03

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	13,145,503.84	3.69
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）	960,680.01	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	14,106,183.85	3.96
----	----	---------------	------

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	019688	22 国债 23	130,000	13,145,503.84	3.69
2	127086	恒邦转债	9,606	960,680.01	0.27

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

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	684,195.50
2	应收清算款	3,924,541.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	792,463.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,401,200.22

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
创金合信量化多因子股票 A	25,006	7,713.66	71,538,895.47	37.09%	121,348,762.65	62.91%
创金合信量化多因子股票 C	61,682	589.96	6,392,183.42	17.57%	29,997,651.96	82.43%
合计	86,137	2,661.78	77,931,078.89	33.99%	151,346,414.61	66.01%

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	创金合信量化多因子股票 A	59,005.09	0.03%
	创金合信量化多因子股票 C	53,277.21	0.15%
	合计	112,282.30	0.05%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信量化多因子股票 A	0~10
	创金合信量化多因子股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化多因子股票 A	0
	创金合信量化多因子股票 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C
基金合同生效日(2016年1月22日)基金份额总额	202,639,215.47	-
本报告期期初基金份额总额	200,889,599.96	117,561,459.01
本报告期基金总申购份额	18,464,157.52	29,712,137.02
减：报告期基金总赎回份额	26,466,099.36	110,883,760.65
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	192,887,658.12	36,389,835.38

§ 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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	111,726,261.84	2.08%	81,223.84	3.82%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	1,087,053,924.86	20.28%	354,575.10	16.68%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	301,666,135.38	5.63%	128,802.85	6.06%	-
恒泰证券	2	237,426,922.56	4.43%	101,472.83	4.77%	-
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	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	884,287,497.16	16.50%	376,416.89	17.71%	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,473,577,413.57	27.50%	479,808.76	22.57%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	347,717,055.15	6.49%	148,453.47	6.98%	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	52,499,781.94	0.98%	22,354.47	1.05%	-
中银国际 证券	2	619,540,651.73	11.56%	263,961.30	12.42%	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
第一创业 证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	214,944,786.02	4.01%	156,227.16	7.35%	-
太平洋证 券	4	28,701,448.11	0.54%	12,271.68	0.58%	-

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财通证券 2 个交易单元、平安证券 2 个交易单元、首创证券 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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	7,000,000.00	3.59%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	551,818.23	2.03%	54,600,000.00	27.97%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	5,000,000.00	2.56%	-	-
恒泰证券	25,437,887.73	93.36%	4,500,000.00	2.31%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	42,973.75	0.16%	27,500,000.00	14.09%	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	113,588.88	0.42%	42,500,000.00	21.77%	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	12,000,000.00	6.15%	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	5,000,000.00	2.56%	-	-
中银国际 证券	-	-	23,000,000.00	11.78%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	1,101,112.12	4.04%	14,100,000.00	7.22%	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信量化多因子股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
3	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、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
4	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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
5	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资	公司官网、中国证监	2023-03-09

	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	会基金电子披露网站	
6	创金合信量化多因子股票型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	创金合信量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20230419	76,275,514.07	0.00	76,275,514.07	0.00	0.00%
机构	2	20230101 - 20230630	64,299,557.47	0.00	0.00	64,299,557.47	28.04%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信量化多因子股票型证券投资基金 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日