

创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 1 月 19 日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示..... | 2 |
| §2 基金产品概况..... | 2 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 5 |
| 3.1 主要财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 5 |
| §4 管理人报告..... | 6 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 7 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 7 |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析..... | 7 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 8 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 8 |
| §5 投资组合报告..... | 8 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 8 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 9 |
| 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细..... | 10 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 10 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 10 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 细..... | 11 |
| 5.7 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..... | 11 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细..... | 11 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 11 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 11 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 11 |
| §6 基金中基金..... | 12 |
| 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... | 12 |
| 6.2 当期交易及持有基金产生的费用..... | 13 |
| 6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件..... | 14 |
| §7 开放式基金份额变动..... | 14 |
| §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 14 |
| 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 14 |
| 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 15 |
| §9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况..... | 15 |
| §10 影响投资者决策的其他重要信息..... | 15 |
| 10.1 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..... | 15 |
| 10.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 16 |
| §11 备查文件目录..... | 16 |
| 11.1 备查文件目录..... | 16 |
| 11.2 存放地点..... | 16 |
| 11.3 查阅方式..... | 16 |

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF） |
| 基金主代码 | 015535 |
| 交易代码 | 015535 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 8 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,619,226.16 份 |
| 投资目标 | 本基金以平衡的投资风格进行长期资产配置，通过大类资产配置与基金优选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金是一只平衡风险策略基金，拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金（包括股票指数基金）以及偏股混合型基金等，非权益类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，拟采用战略型资产配置和战术型资产配置相结合的大类资产配置策略，形成对各类资产预期收益及风险的判断，在一定范围内动态优化配置比例。</p> <p>1、战略型资产配置策略</p> <p>在中长期时间维度内，本基金判断宏观经济发展趋势、政策导向、金融市场发展趋势，结合各类资产的长期收益率、历史波动率、资产之间的相关性、再平衡等因素，在基金合同约定范围内确定战略资产配置的最优比例，并以此作为资产</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>配置调整的中枢。</p> <p>2、战术型资产配置策略</p> <p>在短期时间维度内，本基金通过判断各类资产的估值水平、经济与政策环境边际变化、投资者交易结构等因素，动态评估各类资产的风险收益比与资产间的相关性，抓住相对价值变化和事件驱动带来的投资机会，回避极致分化、交易拥挤带来的投资风险，提高组合的风险调整后收益水平。</p> <p>（二）基金优选策略</p> <p>本基金将根据基金产品特征，通过定量与定性分析相结合的方式，对基金公司、基金经理及基金产品做出综合评价。对基金公司的评价主要考虑平均业绩、管理基金的总规模及增速、管理层稳定性、投研团队配置、风控制度与落实情况、绩效考核机制等维度；对基金经理的评价主要考虑从业年限、投资理念和投资行为的一致性、收益来源及其稳定性等维度；对基金产品的评价主要考虑基金规模、历史业绩、条款设计、持有人结构等。不同类型的基金采用不同的评价体系，具体如下：</p> <p>1、主动股票型基金、混合型基金</p> <p>针对受基金经理主动管理影响较大的普通股票型基金和混合型基金，本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方式，优选能够持续获取稳定收益、保持稳定风格的标的进行配置。定量分析关注基金的风险收益指标、业绩归因、股债配置情况、行业配置情况、持股风格、投资集中度、换手率等指标；定性分析则关注基金经理的从业年限、投资理念和投资行为的一致性等因素，以及基金公司的投研团队、投资决策流程、风控水平、激励机制等因素。</p> <p>2、主动债券型基金</p> <p>针对受基金经理主动管理影响较大的债券型基金，本基金将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，综合考虑债券型基金的运作时间、资产规模、资产配置状况、风险收益指标、历史信用风险事件、费率水平、申购赎回限制、杠杆率等因素，结合基金经理投资理念、投资行为、收益稳定性等因素，以及基金公司信评团队配置、信用风险控制口径、风险处置能力等因素，力求投资组合在较低风险和良好流动性的前提下，提升产品的基础收益、平滑组合收益波动。</p> <p>3、货币市场基金</p> <p>货币市场基金投资策略以流动性管理以及降低投资组合整体波动率水平为目标，综合考虑货币基金的规模、收益水平、流动性、赎回机制等因素。</p> <p>4、指数型基金</p> <p>针对受基金经理主动管理影响较小的指数型基金，本基金将考虑基金的指数风格特征、偏离程度、流动性、费率水平等因素，选择适合的标的进行配置。</p> <p>（三）股票投资策略</p> |
|--|---|

| | | |
|-----------------|--|----------------------------|
| | <p>1、个股投资策略</p> <p>本基金将通过基本面分析，结合定性和定量分析方法，构建运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的股票投资组合。定性分析包括深入了解上市公司的公司治理结构、管理团队、经营主业、所属细分行业的产业政策和政策的变化趋势、核心商业模式，及该商业模式的稳定性和可持续性、战略规划和长期发展前景等；定量分析包括重点关注盈利能力、成长能力、负债水平、营运能力等维度，本基金重点关注的估值指标包括但不限于市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市现率（P/CF）、市销率（P/S）、股息率（D/P）、经济价值/息税折旧摊销前利润（EV/EBIT）等相对估值指标，以及资产重置价格、现金流贴现模型（DCF）、股息率贴现模型（DDM）等绝对估值指标，精选基本面良好、未来盈利空间和发展潜力大的股票。</p> <p>2、港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将采用"自下而上"的个股精选策略，结合公司基本面、相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。</p> <p>3、存托凭证的投资策略</p> <p>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，在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>（四）固定收益品种投资策略</p> <p>1、债券投资策略</p> <p>本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。在个券选择方面，本基金将以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券</p> | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*45%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*5%+中债综合（全价）指数收益率*50% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015535 | 015536 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,135,508.51 份 | 5,483,717.65 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------------------|
| | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 1. 本期已实现收益 | -163,359.57 | -178,702.35 |
| 2. 本期利润 | -33,330.73 | -40,931.01 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0065 | -0.0075 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,801,757.22 | 5,100,046.51 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9350 | 0.9300 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.69% | 0.34% | -2.91% | 0.40% | 2.22% | -0.06% |
| 过去六个月 | -5.20% | 0.39% | -5.01% | 0.43% | -0.19% | -0.04% |
| 过去一年 | -5.41% | 0.43% | -4.69% | 0.42% | -0.72% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -6.50% | 0.40% | -7.03% | 0.48% | 0.53% | -0.08% |

创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.79% | 0.34% | -2.91% | 0.40% | 2.12% | -0.06% |
| 过去六个月 | -5.39% | 0.39% | -5.01% | 0.43% | -0.38% | -0.04% |
| 过去一年 | -5.78% | 0.43% | -4.69% | 0.42% | -1.09% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.00% | 0.40% | -7.03% | 0.48% | 0.03% | -0.08% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|---------|-----------------|---|---|--|
| 罗水星 | 本基金基金经理 | 2022 年 8 月 31 日 | - | 5 | 罗水星先生，中国国籍，上海财经大学博士。2018 年 4 月加入博时基金管理有限公司，历任博士后工作站研究员、宏观分析师、高级宏观分析师，2022 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任宏观策略配置部研究员，现任 FOF 投资二部总监助理、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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 4 季度权益市场整体表现一般，偏股基金指数季度四连跌，4 季度跌幅超过 5%，沪深 300 跌幅更加明显，达到了 7%。市场结构的亮点集中在微盘、煤炭和北证 50 上，主要以资金博弈逻辑为主。全球地缘政治不确定性推动部分大宗商品和贵金属相关标的价格上

涨，海外美联储降息预期拉动美股反弹。受益于流动性预期和基本面现实，国内外债市都迎来一波较为明显的行情。

中央经济工作会议强调 2024 年要“坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策，在转方式、调结构、提质量、增效益上积极进取，不断巩固稳中向好的基础。”市场在期待政策层面具体的稳经济、稳市场、稳预期的政策细节能够进一步落地。

展望 2024 年，在前期权益市场回撤时间已经较长、幅度已经较大的背景下，各市场主体都期待 2024 年能够有一些积极的变化。展望一季度，海外交易宽松预期已经经历了一段时间，国内处在政策的预期阶段。看好 2024 年权益市场的表现机会，但节奏的把握会比较重要。

组合在 2023 年 4 季度以防守反击为主，注重安全垫的基础上适时去做一些阶段性的配置。对于一些反弹的 TMT 板块做了一定的减仓，进一步强化了组合的价值风格的配置，展望 24 年一季度，组合会继续做好防御的基础上等待明确信号出现之后强化进攻属性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起(FOF)A 基金份额净值为 0.9350 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.69%，同期业绩比较基准收益率为-2.91%；截至本报告期末创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C 基金份额净值为 0.9300 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.79%，同期业绩比较基准收益率为-2.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 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 | 253,800.19 | 2.47 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：股票 | 253,800.19 | 2.47 |
| 2 | 基金投资 | 8,503,728.90 | 82.89 |
| 3 | 固定收益投资 | 607,048.77 | 5.92 |
| | 其中：债券 | 607,048.77 | 5.92 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 299,941.98 | 2.92 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 277,408.67 | 2.70 |
| 8 | 其他资产 | 317,721.58 | 3.10 |
| 9 | 合计 | 10,259,650.09 | 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 742.19 元，占净值比为 0.01%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | - | - |
| C | 制造业 | 158,431.00 | 1.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 22,170.00 | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 72,457.00 | 0.73 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 253,058.00 | 2.56 |

5.2.2 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（%） |
|----------|------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 742.19 | 0.01 |
| 合计 | 742.19 | 0.01 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 300043 | 星辉娱乐 | 12,000 | 44,520.00 | 0.45 |
| 2 | 603901 | 永创智能 | 2,600 | 30,940.00 | 0.31 |
| 3 | 688595 | 芯海科技 | 700 | 30,310.00 | 0.31 |
| 4 | 688589 | 力合微 | 700 | 27,937.00 | 0.28 |
| 5 | 300602 | 飞荣达 | 1,500 | 27,105.00 | 0.27 |
| 6 | 688503 | 聚和材料 | 500 | 26,800.00 | 0.27 |
| 7 | 301391 | 卡莱特 | 200 | 22,896.00 | 0.23 |
| 8 | 603128 | 华贸物流 | 3,000 | 22,170.00 | 0.22 |
| 9 | 688526 | 科前生物 | 1,000 | 20,380.00 | 0.21 |
| 10 | H03690 | 美团-W | 10 | 742.19 | 0.01 |

5.4 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 | 607,048.77 | 6.13 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 607,048.77 | 6.13 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 019678 | 22 国债 13 | 6,000 | 607,048.77 | 6.13 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

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。

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。

5.11.1 其他资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,279.05 |
| 2 | 应收清算款 | 315,242.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 11.00 |
| 6 | 其他应收款 | 188.65 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 317,721.58 |

5.11.2 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。

5.11.3 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。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产 净值比例 (%) | 是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金 |
|----|--------|----------------------------|------------|------------------|------------------|----------------------|--|
| 1 | 512890 | 华泰柏瑞 中证红利 低波动 ETF | 契约型开 放式 | 1,221,600 .00 | 1,116,542 .40 | 11.28 | 否 |
| 2 | 006874 | 创金合信 恒兴中短 债债券 A | 契约型开 放式 | 808,410.5 8 | 983,593.1 5 | 9.93 | 是 |
| 3 | 511220 | 城投 ETF | 契约型开 放式 | 79,700.00 | 802,658.7 0 | 8.11 | 否 |
| 4 | 006824 | 创金合信 鑫日享短 债债券 A | 契约型开 放式 | 516,025.4 8 | 621,965.5 1 | 6.28 | 是 |
| 5 | 006626 | 山西证券 超短债债 | 契约型开 放式 | 490,122.2 2 | 544,231.7 1 | 5.50 | 否 |

| | | 券 A | | | | | |
|----|--------|--------------------------------------|------------|----------------|----------------|------|---|
| 6 | 006361 | 财通资管 鸿益中短 债债券 C | 契约型开 放式 | 384,104.9 7 | 412,298.2 7 | 4.16 | 否 |
| 7 | 006076 | 创金合信 恒利超短 债债券 A | 契约型开 放式 | 362,929.6 7 | 380,785.8 1 | 3.85 | 是 |
| 8 | 513290 | 汇添富纳 斯达克生 物科技 ETF(QDI I) | 契约型开 放式 | 327,200.0 0 | 373,335.2 0 | 3.77 | 否 |
| 9 | 511360 | 海富通中 证短融 ETF | 契约型开 放式 | 3,000.00 | 326,100.0 0 | 3.29 | 否 |
| 10 | 006825 | 创金合信 鑫日享短 债债券 C | 契约型开 放式 | 262,123.2 0 | 310,301.4 4 | 3.13 | 是 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023-10-01 至 2023-12-31 | 其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用 |
|--------------------------|---------------------------------|---|
| 当期交易基金产生的申购费 (元) | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费 (元) | 190.07 | 76.43 |
| 当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元) | 1,690.23 | 558.30 |
| 当期持有基金产生的应支付 管理费(元) | 11,389.89 | 4,483.32 |
| 当期持有基金产生的应支付 托管费(元) | 2,477.91 | 1,041.41 |

注：1. 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取，并记入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应

向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

2. 当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,145,082.44 | 5,524,490.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,113.45 | 176.65 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 10,687.38 | 40,949.36 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 5,135,508.51 | 5,483,717.65 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合发起（FOF）C |
|--------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 97.36 | 91.18 |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 94.17 | 10,000,000.00 | 94.17 | 36 个月 |
| 基金管理人高级管理人员 | 14,865.97 | 0.14 | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 67,876.67 | 0.64 | 6,666.95 | 0.06 | 36 个月 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,082,742.64 | 94.95 | 10,006,666.95 | 94.23 | 36 个月 |

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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 | 20231001 - 20231231 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 94.17% |

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。

10.2 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 12 月 31 日,创金合信基金共管理 100 只公募基金,公募管理规模 1188.70 亿元。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信佳和平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年 4 季度报告原文。

11.2 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

11.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日