

创金合信星和稳健 6 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：平安银行股份有限公司

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

§ 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。

基金托管人平安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 | 创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF） |
| 基金主代码 | 016229 |
| 交易代码 | 016229 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年11月2日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,136,364.16份 |
| 投资目标 | 本基金以稳健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>本基金将秉承稳健的投资风格，充分发挥基金管理人的资产配置和基金研究优势，将积极、主动的多资产配置与系统、深入的基金研究相结合，力争在控制整体下行风险的前提下，实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置主要是在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，进行各类资产的比例确定，并根据市场环境的变化进行适度调整，以追求良好的风险收益比。</p> <p>本基金的长期资产配置，基于对国内外宏观经济周期、货币周期、市场状态变化情况的深度研究，采用定量方法和定性研究相结合的方式，确定并动态调整权益类资产、固定收益类资产及其他资产的配置比例。</p> |

| | | |
|-----------------|---|----------------------------|
| | <p>2、基金优选策略</p> <p>本基金通过定量分析与定性分析相结合的方式，对基金公司及其基金做出综合性评价。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、投研团队配置与离职率、风控制度与落实情况、公司受到的奖惩情况等维度；对基金的评价主要考虑历史业绩、风险指标、收益稳定性等，各类型采用不同的评价体系。</p> <p>3、股票投资策略。</p> <p>4、固定收益品种投资策略。</p> <p>5、其他。</p> | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*15%+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*80% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。本基金除可投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信星和稳健 6 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信星和稳健 6 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016229 | 016230 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,130,837.26 份 | 5,005,526.90 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） | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------------------|
| | 创金合信星和稳健 6 个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信星和稳健 6 个月持有期混合发起（FOF）C |
| 1. 本期已实现收益 | -74,195.37 | -76,668.58 |
| 2. 本期利润 | 7,680.23 | 2,601.89 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0015 | 0.0005 |
| 4. 期末基金资产净值 | 5,046,127.40 | 4,900,061.31 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9835 | 0.9789 |

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

创金合信星和稳健6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 | 0.15% | 0.13% | -0.54% | 0.17% | 0.69% | -0.04% |
| 过去六个月 | -1.17% | 0.15% | -1.52% | 0.18% | 0.35% | -0.03% |
| 过去一年 | -0.49% | 0.17% | -0.64% | 0.18% | 0.15% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.65% | 0.17% | 0.75% | 0.19% | -2.40% | -0.02% |

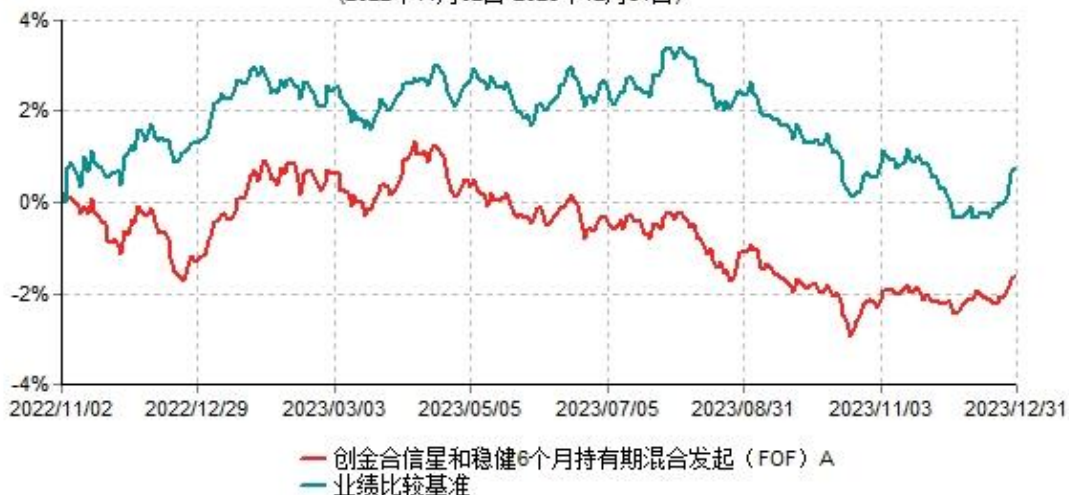
创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）C

| 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 | 0.05% | 0.13% | -0.54% | 0.17% | 0.59% | -0.04% |
| 过去六个月 | -1.36% | 0.15% | -1.52% | 0.18% | 0.16% | -0.03% |
| 过去一年 | -0.89% | 0.17% | -0.64% | 0.18% | -0.25% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.11% | 0.17% | 0.75% | 0.19% | -2.86% | -0.02% |

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

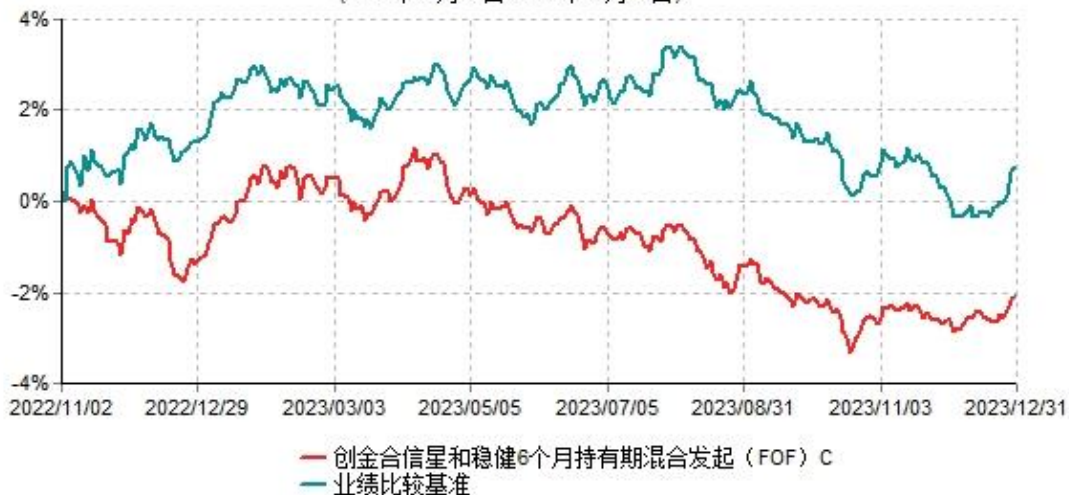
创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年11月02日-2023年12月31日)



创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）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

(2022年11月02日-2023年12月31日)



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11月2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 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 理 | | | | 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遵规守信情况的说明

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

4.3 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。

星和稳健组合在2023年4季度相对而言表现较好，虽然市场整体表现一般，但星和稳健获得了正的收益。这得益于组合在四季度做了比较好的行业轮动，把握了少数行业的绝对收益机会，努力为投资者创造价值。2024年，组合会继续在稳扎稳打的基础上，努力为投资者提供较好的投资体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信星和稳健6个月持有期混合发起(FOF)A基金份额净值为0.9835元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.15%，同期业绩比较基准收益率为-0.54%；截至本报告期末创金合信星和稳健6个月持有期混合发起(FOF)C基金份额净值为0.9789元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.54%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|--------------|--------|
| 2 | 基金投资 | 8,224,588.77 | 82.41 |
| 3 | 固定收益投资 | 607,048.77 | 6.08 |
| | 其中：债券 | 607,048.77 | 6.08 |
| | 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 | 799,923.80 | 8.02 |
| | 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 | 246,238.06 | 2.47 |
| 8 | 其他资产 | 101,963.80 | 1.02 |
| 9 | 合计 | 9,979,763.20 | 100.00 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 6.10 |
| 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 | 6.10 |

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

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 | 6.10 |

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 | 1,622.45 |
| 2 | 应收清算款 | 100,304.77 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 36.58 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 101,963.80 |

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 | 007828 | 创金合信 信用红利 债券 A | 契约型开 放式 | 1,144,006 .07 | 1,427,376 .37 | 14.35 | 是 |
| 2 | 006824 | 创金合信 鑫日享短 债债券 A | 契约型开 放式 | 944,128.0 9 | 1,137,957 .59 | 11.44 | 是 |
| 3 | 511220 | 海富通上 证城投债 ETF | 契约型开 放式 | 99,500.00 | 1,002,064 .50 | 10.07 | 否 |
| 4 | 006874 | 创金合信 恒兴中短 债债券 A | 契约型开 放式 | 551,884.2 7 | 671,477.5 9 | 6.75 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|-----------------------|--------|------------|------------|------|---|
| 5 | 009005 | 创金合信鑫祺混合A | 契约型开放式 | 386,441.89 | 446,572.25 | 4.49 | 是 |
| 6 | 513290 | 汇添富纳斯达克生物科技ETF(QDI I) | 契约型开放式 | 386,400.00 | 440,882.40 | 4.43 | 否 |
| 7 | 511360 | 海富通中证短融ETF | 契约型开放式 | 3,300.00 | 358,710.00 | 3.61 | 否 |
| 8 | 001711 | 安信新趋势混合C | 契约型开放式 | 261,551.87 | 308,631.21 | 3.10 | 否 |
| 9 | 001123 | 鹏华弘利混合C | 契约型开放式 | 201,310.93 | 306,254.32 | 3.08 | 否 |
| 10 | 519682 | 交银增利债券C | 契约型开放式 | 293,973.54 | 298,383.14 | 3.00 | 否 |

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） | 447.40 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 2,594.31 | 108.10 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 11,849.95 | 4,529.98 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 2,865.57 | 1,082.91 |

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 | 创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）C |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,152,475.84 | 5,005,516.64 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,212.25 | 10.26 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 29,850.83 | - |
| 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 | 5,130,837.26 | 5,005,526.90 |

§ 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 | 创金合信星和稳健6个月持有期混合发起（FOF）A | 创金合信星和稳健6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 | 5,000,889.06 | 5,000,888.88 |
| 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 | 5,000,889.06 | 5,000,888.88 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 97.47 | 99.91 |

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 | 10,001,777.94 | 98.67 | 10,001,777.94 | 98.67 | 36个月 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 50,251.49 | 0.50 | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,052,029.43 | 99.17 | 10,001,777.94 | 98.67 | 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 | 10,001,777.94 | 0.00 | 0.00 | 10,001,777.94 | 98.67% |

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、《创金合信星和稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信星和稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信星和稳健 6 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