

创金合信稳健添利债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 1 月 20 日

§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.....	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.....	8
5.3 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.....	9
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明 细.....	10
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.....	10
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.....	10
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 开放式基金份额变动.....	13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
8.1 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
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	14
§9 备查文件目录.....	14
9.1 备查文件目录.....	14
9.2 存放地点.....	14
9.3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信稳健添利债券
基金主代码	015782
交易代码	015782
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 24 日
报告期末基金份额总额	165,455,817.72 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略。本基金通过上下结合的宏观和微观研究，综合考虑权益的估值水平、风险收益比和固定收益资产的预期收益状况，合理确定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。在控制净值波动，追求稳健增值的基础上，尽可能提高基金的收益水平。</p> <p>2、债券投资策略。本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、回购放大等策略，力争实现基金资产的稳健增值。主要具体包括（但不局限于）：（1）久期配置策略；（2）期限结构配置策略；（3）债券类别配置策略；（4）信用投资策略（含资产支持证券，下同）；本基金在信用债投资过程中，可投资的信用债信用评级范围为 AA+、AAA 级（有债项评级的以债项评级为准，无债项评级的以主体评级为准，短期融资券、超短期融资券参照主体评级），前述不同评级信用债券占持仓信用债比例分别为 0-50%、50%-100%。上述信</p>

	<p>用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，评级机构以基金管理人选定为准。（5）跨市场套利策略；（6）回购放大策略；（7）可转换债券和可交换债券投资策略。</p> <p>3、股票投资策略。（1）A 股投资策略。本基金的权益类投资以实现绝对收益为目标，严格控制权益类投资组合下跌风险。（2）港股通标的股票投资策略。（3）存托凭证的投资策略。</p> <p>4、国债期货投资策略。为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。</p> <p>5、信用衍生品投资策略。本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、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。</p>	
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*12%+中证港股通综合指数收益率*3%	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信稳健添利债券 A	创金合信稳健添利债券 C
下属分级基金的交易代码	015782	015783
报告期末下属分级基金的份额总额	141,288,327.58 份	24,167,490.14 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（2022 年 10 月 1 日—2022 年 12 月 31 日）	
	创金合信稳健添利债券 A	创金合信稳健添利债券 C

1.本期已实现收益	2,103,285.58	18,920.77
2.本期利润	3,292,636.73	-54,177.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0226	-0.0193
4.期末基金资产净值	143,992,249.73	24,648,050.54
5.期末基金份额净值	1.0191	1.0199

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

创金合信稳健添利债券 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	2.27%	0.28%	0.71%	0.19%	1.56%	0.09%
过去六个月	1.90%	0.22%	-0.57%	0.17%	2.47%	0.05%
自基金合同生效起至今	1.91%	0.22%	-0.15%	0.17%	2.06%	0.05%

创金合信稳健添利债券 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	2.33%	0.28%	0.71%	0.19%	1.62%	0.09%
过去六个月	1.98%	0.22%	-0.57%	0.17%	2.55%	0.05%
自基金合同生效起至今	1.99%	0.22%	-0.15%	0.17%	2.14%	0.05%

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：1、本基金合同于 2022 年 6 月 24 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，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		
黄弢	本基金	2022 年 6	-	20	黄弢先生，中国国籍，清华大学法学硕

	基金经 理、权 益投研 总部执 行总 监、风 格策略 投资部 和稳健 收益投 资部总 监	月 24 日			士，2002 年 7 月加入长城基金管理有限 公司，任市场部渠道主管，2005 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任市 场部南方区总经理、2008 年 2 月加入深 圳市鼎诺投资管理有限公司，任公司执 行总裁，2017 年 5 月加入北京和聚投 资管理有限公司任首席策略师，2018 年 4 月加入上海禾驹投资管理中心（有限合 伙），任首席策略师，2020 年 2 月加入创 金合信基金管理有限公司，现任权益投 研总部执行总监、兼任风格策略投资部 和稳健收益投资部总监、基金经理。
谢创	本基金 基金经 理	2022 年 6 月 24 日	-	7	谢创先生，中国国籍，西南财经大学金 融工程硕士，2015 年 7 月加入创金合信 基金管理有限公司，曾任交易部交易员， 固定收益部基金经理助理，现任基金经 理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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

2022 年第四季度债券市场出现显著上行，信用债表现弱于利率债，信用利差显著走阔。四季度因疫情政策调整，市场对于后续经济增长恢复预期强劲，导致债券市场收益率出现显著上行。在上行过程中，因净值化转型，债券型理财净值持续下跌后，带来了阶段性的赎回冲击，赎回冲击中，信用债抛售压力较大，信用利差极速走扩。随后，因央行持续的公开市场投放，稳定资金面预期等因素，债券市场逐步企稳修复，信用利差高位回落。股票市场方面，2022 年 4 季度尤其是 10 月份，延续了 2022 年 9 月以来的大调整，形成了 2022 年除 3 月和 4 月之外的最大两个调整月度，香港市场更是在 10 月份跌出了 10 多年来的估值新低。但随着 10 月下旬房地产和疫情防控政策的进一步调整，市场进入快速修复阶段，最终 4 季度整体来看，各大指数以微涨收盘。

展望 2023 年，经济恢复的方向是确定的，但恢复的强度有多强，仍然有一定的不确定性。消费方面，疫情因子对消费场景的压制基本消失，但居民消费意愿与消费能力有多大的释放，仍有一定不确定性，目前仍需观察，更大概率还是需要经济提升，收入预期提升在前，消费提升在后。投资方面，预计政府投资仍要承担重要角色，但财政发力的程度，预计与 2022 年相接近，不易出现加大力度的财政刺激。出口方面，海外经济增长动能大概率逐步减弱，过去两年出口高速增长的情况难以为继，出口难以成为经济增长的推动项。地产方面，当前政策仍在持续推动，但地产消费的信心以及本身地产所处的周期位置，都决定了地产方面即使有恢复，但要回到过去十年地产高速增长的状态，是基本不可能的，地产方面的恢复不易触发到央行防风险的底线。资金面方面，2023 年总体定调精准有力，全面宽松的货币政策大概率不会看到，而结构性政策的发力往往又不会伴随总量上紧缩的政策，对于货币政策这块，建议更加中性的看待，资金中枢收敛政策利率，但总量体感不收紧是更大可能的结果。综上所述，2023 年债券市场略有逆风，但考虑到当前债券估值收益率水平基本处在正常水平，债券总体处于偏震荡行情，短债确定性优于长债，杠杆策略优于久期策略；股票市场整体在温和复苏背景下，大概率维持震荡上行的趋势。

债券组合部分，产品在四季度中，随着信用利差的逐步走阔，产品逐步降低利率债仓位，替换为高评级信用债，并适当提升产品久期，保持产品杠杆，以提升产品的静态配置收益水平。后续产品债券部分仍将以高评级信用债与利率债投资为主，兼顾流动性的前提下，追求合理的超额收益。

股票组合部分，本基金在 4 季度的操作仍然以逢低加仓，逢高减仓为第一原则，自 9 月份开始加仓以来，在 10 月市场下行的过程中继续增加权益仓位，并在随后的 11 月和 12 月的反弹过程中慢慢降低权益仓位，持仓方向以 TMT、中游制造、消费医药和金融地产为

主。下一阶段，整体看经济进入复苏周期，从目前看弱复苏的概率更大，政策仍然以加力扶持为主，尤其是在财政政策，以及对应的产业政策支持上，因此市场仍将有机会在温和复苏的背景下走出震荡上行的趋势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信稳健添利债券 A 基金份额净值为 1.0191 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；截至本报告期末创金合信稳健添利债券 C 基金份额净值为 1.0199 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	26,186,647.60	13.16
	其中：股票	26,186,647.60	13.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	169,495,739.62	85.18
	其中：债券	169,495,739.62	85.18
	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	-	-
	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	3,240,716.63	1.63
8	其他资产	51,393.73	0.03
9	合计	198,974,497.58	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

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	635,050.00	0.38
B	采矿业	291,456.00	0.17
C	制造业	20,176,921.12	11.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,275,988.00	0.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,646,872.48	0.98
K	房地产业	487,518.00	0.29
L	租赁和商务服务业	547,092.00	0.32
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	1,125,750.00	0.67
S	综合	-	-
	合计	26,186,647.60	15.53

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 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	002415	海康威视	64,500	2,236,860.00	1.33
2	600887	伊利股份	54,100	1,677,100.00	0.99
3	000333	美的集团	29,800	1,543,640.00	0.92
4	000063	中兴通讯	59,000	1,525,740.00	0.90
5	600031	三一重工	89,900	1,420,420.00	0.84
6	000001	平安银行	99,428	1,308,472.48	0.78
7	300413	芒果超媒	37,500	1,125,750.00	0.67
8	002459	晶澳科技	15,200	913,368.00	0.54
9	000651	格力电器	28,200	911,424.00	0.54
10	300850	新强联	16,800	895,104.00	0.53

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	9,998,112.33	5.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,896,340.66	58.64
	其中：政策性金融债	61,220,362.47	36.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,015,965.48	5.94
6	中期票据	50,585,321.15	30.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	169,495,739.62	100.51

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	210213	21 国开 13	300,000	30,187,900.00	17.90
2	092218001	22 农发清发 01	207,000	21,095,954.14	12.51
3	101900666	19 富阳城投 MTN001	100,000	10,470,213.70	6.21
4	102100892	21 余杭交通 MTN002	100,000	10,304,682.74	6.11
5	2028023	20 招商银行永续债 01	100,000	10,232,372.60	6.07

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2022 年 3 月 21 日，国家开发银行收到中国银行保险监督管理委员会《行政处罚决定书》，认定国家开发银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条、第 46 条规定，并对公司处以罚款 440 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，国家开发银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该银行经营状况正常。另外，440 万元罚款对国家开发银行业绩影响非常有限。该银行作为国家政策性银行之一，信用资质极强，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对国家开发银行相关债券进行了投资。

2022 年 8 月 16 日，杭州富阳城市建设投资集团有限公司（简称“富阳城投”）收到杭州市生态环境局《行政处罚决定书》，认定富阳城投未依法履行职责、违反建设项目环境影响评价制度、污染环境，违反了《浙江生态环境厅关于印发浙江省生态环境保护综合行政执法事项目录（2020 年版）》、《杭州市综合行政执法事项划转清单》、《风景名胜区条例》第四十一条和《浙江省生态环境行政处罚裁量基准规定》，并对公司处以罚款 33.20 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，富阳城投改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，上述事件发生后该公司经营状况正常。另外，33.20 万元罚款对其经营影响非常小。该公司作为杭州富阳区核心城投平台，融资能力和经营能力强，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对富阳城投相关债券进行了投资。

2022 年 11 月 4 日，招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）收到中国人民银行处罚决定书，认定招商银行存在违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定等违法违规行为，并处以警告、没收违法所得 5.69 万元、罚款 3423.5 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，招商银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该银行经营状况正常。另外，3423.5 万元罚款对招商银行业绩影响非常有限。该银行作为全国性股份制银行之一，信用资质较强，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行相关债券进行了投资。

2022 年 3 月 21 日，中国农业发展银行收到中国银行保险监督管理委员会《银保监罚决字(2022)10 号》，认定中国农业发展银行监管标准化数据系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，如漏报不良贷款余额 EAST、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条和第 46 条的规定，处以罚款 480 万元。本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，中国农业发展银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国农业发展银行相关债券进行了投资。

5.11.2

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。

5.11.3 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	29,662.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,731.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	51,393.73

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300850	新强联	895,104.00	0.53	停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信稳健添利债券 A	创金合信稳健添利债券 C
报告期期初基金份额总额	151,466,235.61	22,747,301.82
报告期期间基金总申购份额	245,543.40	23,983,777.88
减：报告期期间基金总赎回份额	10,423,451.43	22,563,589.56
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	141,288,327.58	24,167,490.14

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 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。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20221001 - 20221231	40,000,800.00	0.00	0.00	40,000,800.00	24.18%
机构	2	20221114 - 20221227	29,911,287.63	0.00	0.00	29,911,287.63	18.08%

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。

8.2 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 2022 年 12 月 31 日,创金合信基金共管理 90 只公募基金,公募管理规模 940.93 亿元。

§ 9 备查文件目录**9.1 备查文件目录**

- 1、《创金合信稳健添利债券型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信稳健添利债券型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信稳健添利债券型证券投资基金 2022 年 4 季度报告原文。

9.2 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

9.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 1 月 20 日