

创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2023 年年度报告

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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本年度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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2023 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3 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.....	56

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6	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	63
8.7	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	64
8.8	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	64
8.9	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	64
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12	投资组合报告附注	64
§9	基金份额持有人信息	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3	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的情况	66
§10	开放式基金份额变动	66
§11	重大事件揭示	67
11.1	基金份额持有人大会决议	67
11.2	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	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4	基金投资策略的改变	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8	其他重大事件	68
§12	影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1	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	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§13	备查文件目录	70
13.1	备查文件目录	70
13.2	存放地点	70
13.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信鑫祺混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信鑫祺混合	
基金主代码	009005	
交易代码	009005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 4 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,679,084,175.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C
下属分级基金的交易代码	009005	009006
报告期末下属分级基金的份 额总额	842,142,974.02 份	836,941,201.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等，以判断经济波动对市场的影响；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；（3）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
		朱巍

	联系电话	0755-82820166	0571-87659806
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-868-0666	95527
传真		0755-25832571	0571-88268688
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	杭州市萧山区鸿宁路1788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	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		518052	310006
法定代表人		钱龙海	陆建强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信鑫祺混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	49,464,078.01	46,873,462.90	64,597,859.21
本期利润	-4,551,648.22	42,266,181.39	57,311,822.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0047	0.0645	0.1283
本期加权平均净值利润率	-0.40%	5.49%	10.47%
本期基金份额净值增长率	1.56%	3.49%	9.69%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	131,031,365.32	80,708,944.32	170,949,187.01
期末可供分配基金份额利润	0.1556	0.1378	0.2916
期末基金资产净值	973,174,339.34	666,518,662.09	757,212,872.03
期末基金份额净值	1.1556	1.1378	1.2916
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	35.76%	33.67%	29.16%

2、创金合信鑫祺混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	36,496,072.54	22,945,910.56	32,259,634.53
本期利润	-20,518,796.94	2,546,616.10	27,954,410.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0247	0.0073	0.1322
本期加权平均净值利润率	-2.14%	0.61%	10.70%
本期基金份额净值增长率	1.16%	3.07%	9.26%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	116,254,402.71	36,243,900.58	112,694,590.13
期末可供分配基金份额利润	0.1389	0.1258	0.2832
期末基金资产净值	953,195,604.42	324,372,737.32	510,642,634.54
期末基金份额净值	1.1389	1.1258	1.2832
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	33.80%	32.26%	28.32%

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。

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

创金合信鑫祺混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.92%	0.35%	-0.76%	0.16%	-0.16%	0.19%
过去六个月	-1.31%	0.29%	-1.52%	0.17%	0.21%	0.12%
过去一年	1.56%	0.24%	-0.64%	0.17%	2.20%	0.07%
过去三年	15.30%	0.34%	-3.85%	0.22%	19.15%	0.12%
自基金合同生效起至今	35.76%	0.37%	0.09%	0.23%	35.67%	0.14%

创金合信鑫祺混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.02%	0.35%	-0.76%	0.16%	-0.26%	0.19%
过去六个月	-1.51%	0.29%	-1.52%	0.17%	0.01%	0.12%
过去一年	1.16%	0.24%	-0.64%	0.17%	1.80%	0.07%
过去三年	13.92%	0.34%	-3.85%	0.22%	17.77%	0.12%
自基金合同生效起至今	33.80%	0.37%	0.09%	0.23%	33.71%	0.14%

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

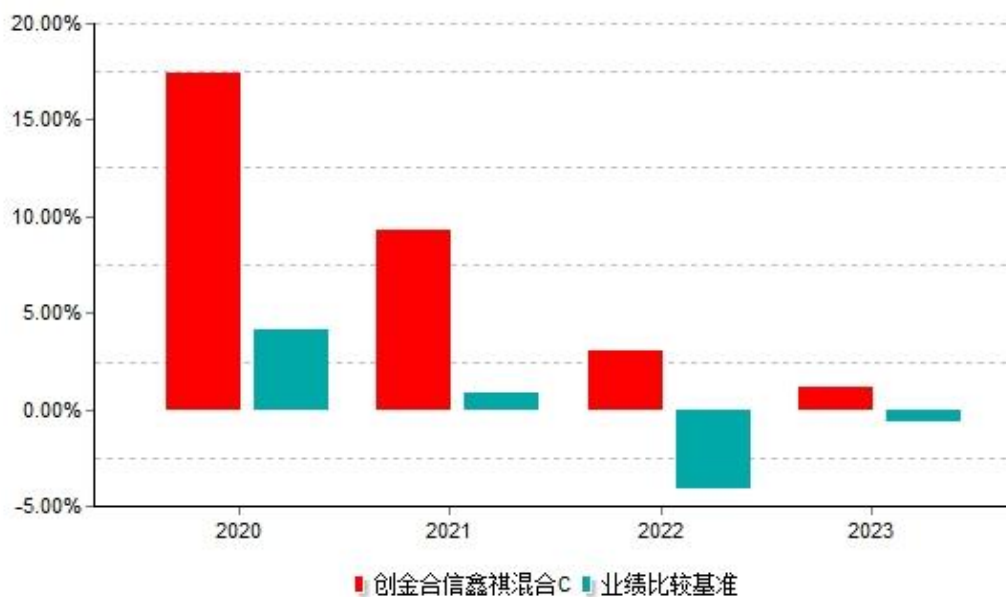
创金合信鑫祺混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年03月04日-2023年12月31日)





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金于 2020 年 3 月 4 日成立，截至 2020 年 12 月 31 日基金成立未满 1 年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

创金合信鑫祺混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	1.923	105,724,304.06	65,256,422.08	170,980,726.14	-
合计	1.923	105,724,304.06	65,256,422.08	170,980,726.14	-

创金合信鑫祺混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	1.907	8,521,531.18	47,230,718.38	55,752,249.56	-
合计	1.907	8,521,531.18	47,230,718.38	55,752,249.56	-

§ 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		
吕沂洋	本基金基金经理	2022 年 3 月 7 日	-	8	吕沂洋先生，中国国籍，中山大学硕士。2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部投资顾问，现任基金经理。
黄弢	本基金基金经理、权益投研总部总监、行业投资研究部总监、风格策略投资部和稳健收益投资部总监	2020 年 5 月 8 日	-	21	黄弢先生，中国国籍，清华大学硕士。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，现任权益投研总部总监、兼任行业投资研究部总监、风格策略投资部和稳健收益投资部总监、基金经理。
闫一帆	本基金基金经理	2020 年 3 月 20 日	-	14	闫一帆先生，中国国籍，新加坡南洋理工大学硕士。2008 年 7 月加入国泰君安证券股份有限公司，任机构销售，2011 年 5 月加入永安财产保险股份有限公司，任投资管理中心固定收益研究员，2012 年 10 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理部固定收益研究员，2014

					年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理、信用研究主管、固定收益部副总监，现任固定收益总部执行总监、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》（下称“管理制度”），该管理制度涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。本报告期内，本公司严格执行该管理制度的要求，实行了如下具体控制措施：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

执行投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立健全客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据，确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立健全不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立健全公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司执行异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，其中 10 日内价差分析仅适用于兼任了私募资产管理计划投资经理的基金经理所管理的多个投资组合，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益部分，2023 年是市场超预期下行的一年，最终沪深 300 指数创出连跌 3 年的历史记录。回过头来看，市场下行与经济修复低于预期有本质的关系，但延续至 2023 年 4 季度，市场下行已经与政策面和基本面没有多大关系，因为基本面层面出现改善迹象，从政策面来看各项托底措施不断，而市场整体的估值水平也是在历史极低分位的区间，但投资者基本无视这些利好因素，投资者讨论更多的依然是在证券史中反复讨论的问题：就是这一次是否和以往不一样，市场的走势反映出投资者的悲观预期，即这一次和以往不一样，甚至

也有投资者开始讨论估值体系是否还有效的问题。在市场进入下行通道的过程中，这种观点很容易和市场走势形成负向循环，从而加剧市场的波动，但过往多年的证券史其实证明了阳光底下没有新鲜事，证券市场还是受投资者贪婪和恐惧的情绪驱动，因此每次都不会例外，循环最终会被打破，而再次进入反向的循环，需要的只是一点信心和耐心，我本人也深信这一点。因此在 2023 年市场下行的过程中，本基金维持越跌越买的逆向投资策略，行业持仓以中游制造、大消费、TMT 和周期股为主，对于后市仍然持乐观观点，相信常识，相信均值回归的基本规律。

债券部分，2023 年上半年，市场先后经历了宏观经济“强预期”与“弱现实”的转变。年初，基于疫情防控政策优化后的乐观预期，市场普遍看好 2023 年的经济复苏态势，对于债市情绪有一定压制；一季度后半段，由于经济数据的不及预期，债市情绪迅速转向。二季度，央行货币政策明显宽松，债市收益率持续下行。下半年中央政治局会议以后，地产调控优化政策密集出台，财政持续加力提效，经济基本面也有所修复，资金利率中枢也在逐步抬升，债市利率整体震荡上行；国庆节后，随着特殊再融资债与特别国债的增量发行，在政府债券集中加大供给的背景下，资金面成为影响债市的主导因素，债市表现偏弱；年末，随着央行对于跨年资金的呵护，资金面偏宽松，债市收益率有一定下行。

另外，在“一揽子化债方案”的政策指导下，2023 年中低资质城投债收益率大幅下行，信用利差大幅收窄。以中债收益率曲线来看，3 年期中债中短期票据到期收益率（AA）与同期限中债国债到期收益率的利差，从 2022 年年末的 160bp 收窄至 2023 年年末的 80bp。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫祺混合 A 基金份额净值为 1.1556 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%；截至本报告期末创金合信鑫祺混合 C 基金份额净值为 1.1389 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.16%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益部分，对于后市仍然持乐观观点，相信常识，相信均值回归的基本规律。

债券部分，货币政策在短期内很可能会维持宽松状态，而财政政策将适度发力。因此，短期内的债券风险相对较低，但长期债券可能会受到政策调整等因素的影响加大波动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规的要求，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

合规管理方面，强化合规法务工作，严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，及时发布合规提示或警示，并通过合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等方式对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行；加强合规制度建设，根据法律法规、监管政策要求，持续完善投资、研究、交易以及从业人员投资行为、反洗钱等方面的管理制度；完善信息披露工作，优化信息披露流程及各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作。

风险控制方面，健全全面风险管理体系，加强权限管理，完善事前、事中和事后的风险管理体系；加强关联交易管理、内幕交易防控机制，严格履行关联交易决策审批程序，定期开展关于防范内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；健全公平交易与异常交易管理机制，严格按照法律法规以及公司公平交易与异常交易相关制度的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控。

稽核方面，公司定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，警示公司管理及业务运作中存在的风险，提出整改意见并监督落实；根据法律法规、监管政策要求，公司每年进行内部控制、合规管理有效性、反洗钱、廉洁从业以及信息技术管理等方面的稽核评估工作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，创金合信鑫祺混合型证券投资基金的管理人—创金合信基金管理有限公司在创金合信鑫祺混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2022 年年度报告中财务指标、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复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2402378 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信鑫祺混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的创金合信鑫祺混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关

	<p>基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶云晖	刘西茜
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层	
审计报告日期	2024年3月27日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	16,611,653.94	36,338,794.39
结算备付金		7,813,360.93	780,573.40
存出保证金		762,736.12	523,038.66

交易性金融资产	7.4.7.2	2,375,187,458.51	1,078,988,381.79
其中：股票投资		671,386,147.95	222,079,747.75
基金投资		-	-
债券投资		1,703,801,310.56	856,908,634.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	40,008,921.73	-
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		46,696,963.60	216,376.84
应收股利		-	-
应收申购款		2,503,412.60	6,048,875.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,489,584,507.43	1,122,896,040.12
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		555,597,172.72	130,128,152.71
应付清算款		239,854.68	-
应付赎回款		4,462,623.07	189,559.40
应付管理人报酬		1,477,916.29	643,635.09
应付托管费		184,739.54	80,454.39
应付销售服务费		361,427.68	103,336.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		33,747.10	37,013.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	857,082.59	822,488.96
负债合计		563,214,563.67	132,004,640.71
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,679,084,175.73	873,938,554.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	247,285,768.03	116,952,844.90

净资产合计		1,926,369,943.76	990,891,399.41
负债和净资产总计		2,489,584,507.43	1,122,896,040.12

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，创金合信鑫祺混合 A 份额净值 1.1556 元，基金份额总额 842,142,974.02 份；创金合信鑫祺混合 C 份额净值 1.1389 元，基金份额总额 836,941,201.71 份；总份额合计 1,679,084,175.73 份。

7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,028,089.50	59,554,298.47
1.利息收入		293,487.91	293,952.00
其中：存款利息收入	7.4.7.9	141,025.58	198,033.42
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		152,462.33	95,918.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		114,371,893.59	81,129,999.11
其中：股票投资收益	7.4.7.10	44,247,464.40	35,201,953.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	63,192,301.55	40,660,498.45
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	6,932,127.64	5,267,546.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-111,030,595.71	-25,006,575.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	7.4.7.16	2,393,303.71	3,136,923.33

号填列)			
减：二、营业总支出		31,098,534.66	14,741,500.98
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	16,594,228.87	9,470,909.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	2,074,278.68	1,183,863.64
3.销售服务费	7.4.10.2.3	3,798,378.43	1,675,820.37
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		8,354,908.25	2,091,857.39
其中：卖出回购金融资产支出		8,354,908.25	2,091,857.39
6.信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		47,540.43	80,550.13
8.其他费用	7.4.7.18	229,200.00	238,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,070,445.16	44,812,797.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,070,445.16	44,812,797.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-25,070,445.16	44,812,797.49

7.3 净资产变动表

会计主体：创金合信鑫祺混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	873,938,554.51	-	116,952,844.90	990,891,399.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	873,938,554.51	-	116,952,844.90	990,891,399.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	805,145,621.22	-	130,332,923.13	935,478,544.35
（一）、综合收益总额	-	-	-25,070,445.16	-25,070,445.16

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	805,145,621.22	-	155,403,368.29	960,548,989.51
其中: 1.基金申购款	3,042,486,084.13	-	492,082,641.04	3,534,568,725.17
2.基金赎回款	-2,237,340,462.91	-	-336,679,272.75	-2,574,019,735.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,679,084,175.73	-	247,285,768.03	1,926,369,943.76
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	984,211,729.43	-	283,643,777.14	1,267,855,506.57
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	984,211,729.43	-	283,643,777.14	1,267,855,506.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-110,273,174.92	-	-166,690,932.24	-276,964,107.16
(一)、综合收益总额	-	-	44,812,797.49	44,812,797.49
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-110,273,174.92	-	15,229,245.97	-95,043,928.95
其中: 1.基金申购款	1,589,169,443.18	-	293,049,478.28	1,882,218,921.46
2.基金赎回款	-1,699,442,618.10	-	-277,820,232.31	-1,977,262,850.41

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-226,732,975.70	-226,732,975.70
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	873,938,554.51	-	116,952,844.90	990,891,399.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信鑫祺混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2020年1月16日证监许可[2020]123号文《关于准予创金合信鑫祺混合型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金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》及其配套规则和《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2020年3月4日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为200,107,445.89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,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

本基金于2020年2月20日至2020年2月27日募集,募集期间净认购资金人民币200,044,438.51元,认购资金在募集期间产生的利息人民币63,007.38元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,107,445.89份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第2000225号验资报告。

根据《创金合信鑫祺混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费,但不计提销售服务费的基金份额类别为A类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同,本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值,计算公式如下: T日某类基金份额的基金份额净值=T日该类基金份额的基金资产净值/T日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信鑫祺混合型证券投资基金招募说明书》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及存托凭证(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票及存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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、货币市场工具、同业存单、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 60%；本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的商业模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在商业模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的,本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础,对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额,即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时,本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失,是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回,则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是,被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。

已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(c) 本基金各类基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(d) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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[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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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]140 号文《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 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	16,611,653.94	36,338,794.39
等于：本金	16,609,351.34	36,336,249.31
加：应计利息	2,302.60	2,545.08
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	16,611,653.94	36,338,794.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	840,738,840.62	-	671,386,147.95	-169,352,692.67	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	637,167,353.17	7,972,820.67	645,232,372.59	92,198.75
	银行间市场	1,037,882,502.61	12,916,237.97	1,058,568,937.97	7,770,197.39
	合计	1,675,049,855.78	20,889,058.64	1,703,801,310.56	7,862,396.14
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,515,788,696.40	20,889,058.64	2,375,187,458.51	-161,490,296.53	

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	269,632,005.46	-	222,079,747.75	-47,552,257.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	194,879,991.56	2,459,856.13	196,403,725.60	-936,122.09
	银行间市场	651,543,621.02	10,932,608.44	660,504,908.44	-1,971,321.02
	合计	846,423,612.58	13,392,464.57	856,908,634.04	-2,907,443.11
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,116,055,618.04	13,392,464.57	1,078,988,381.79	-50,459,700.82	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	40,008,921.73	-
合计	40,008,921.73	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	----------------------	-----------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,063.33	19.23
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	654,719.26	621,169.73
其中：交易所市场	593,417.74	600,006.44
银行间市场	61,301.52	21,163.29
应付利息	-	-
预提费用	201,300.00	201,300.00
合计	857,082.59	822,488.96

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信鑫祺混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	585,809,717.77	585,809,717.77
本期申购	1,354,820,574.03	1,354,820,574.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,098,487,317.78	-1,098,487,317.78
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	842,142,974.02	842,142,974.02

创金合信鑫祺混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	288,128,836.74	288,128,836.74
本期申购	1,687,665,510.10	1,687,665,510.10
本期赎回（以“-”号填列）	-1,138,853,145.13	-1,138,853,145.13
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	836,941,201.71	836,941,201.71

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信鑫祺混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	128,727,226.90	-48,018,282.58	80,708,944.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	128,727,226.90	-48,018,282.58	80,708,944.32
本期利润	49,464,078.01	-54,015,726.23	-4,551,648.22
本期基金份额交易产生的变动数	49,626,770.07	5,247,299.15	54,874,069.22

其中：基金申购款	325,495,712.47	-97,834,134.92	227,661,577.55
基金赎回款	-275,868,942.40	103,081,434.07	-172,787,508.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	227,818,074.98	-96,786,709.66	131,031,365.32

创金合信鑫祺混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,761,150.19	-23,517,249.61	36,243,900.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	59,761,150.19	-23,517,249.61	36,243,900.58
本期利润	36,496,072.54	-57,014,869.48	-20,518,796.94
本期基金份额交易产生的变动数	115,499,385.40	-14,970,086.33	100,529,299.07
其中：基金申购款	391,022,593.29	-126,601,529.80	264,421,063.49
基金赎回款	-275,523,207.89	111,631,443.47	-163,891,764.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	211,756,608.13	-95,502,205.42	116,254,402.71

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	86,020.58	158,055.18
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	44,998.38	32,541.85
其他	10,006.62	7,436.39
合计	141,025.58	198,033.42

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,247,464.40	35,201,953.81
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	44,247,464.40	35,201,953.81

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,291,938,610.04	1,807,128,194.52
减：卖出股票成本总额	2,241,680,037.23	1,767,194,610.78
减：交易费用	6,011,108.41	4,731,629.93
买卖股票差价收入	44,247,464.40	35,201,953.81

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	59,704,101.69	36,646,665.92
债券投资收益——买卖债券（债 转股及债券到期兑付）差价收入	3,488,199.86	4,013,832.53
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	63,192,301.55	40,660,498.45

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	4,810,646,956.75	2,559,044,027.52
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	4,747,353,555.54	2,512,246,118.48
减：应计利息总额	59,735,693.92	42,729,838.20
减：交易费用	69,507.43	54,238.31
买卖债券差价收入	3,488,199.86	4,013,832.53

7.4.7.11.3 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.11.4 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,932,127.64	5,267,546.85
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	6,932,127.64	5,267,546.85

7.4.7.15 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-111,030,595.71	-25,006,575.97
——股票投资	-121,800,434.96	-17,415,020.67
——债券投资	10,769,839.25	-7,591,555.30
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-111,030,595.71	-25,006,575.97

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,282,316.15	3,133,834.52
转换费收入	110,987.56	3,088.81
合计	2,393,303.71	3,136,923.33

7.4.7.17 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	72,000.00	72,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	45,000.00
查询服务费	1,200.00	1,500.00
合计	229,200.00	238,500.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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
浙商银行股份有限公司	基金托管人
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	2,031,790,247.37	57.79%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	139,268,021.70	39.39%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	1,099,600,000.00	81.39%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,471,303.63	57.70%	-	-

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,594,228.87	9,470,909.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,398,274.94	1,533,226.95
应支付基金管理人的净管理费	12,195,953.93	7,937,682.50

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 0.8% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,074,278.68	1,183,863.64

注：支付基金托管人浙商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C	合计
创金合信直销	-	466,004.14	466,004.14
第一创业证券	-	220.69	220.69
合计	-	466,224.83	466,224.83
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C	合计
创金合信直销	-	68,352.03	68,352.03
第一创业证券	-	-	-

合计	-	68,352.03	68,352.03
----	---	-----------	-----------

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 0.4% 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 × 0.4% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	16,611,653.94	86,020.58	36,338,794.39	158,055.18

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内购买基金托管人浙商银行发行的 21 浙商银行永续债而取得的利息收入为人民币 5,063.01 元，截至 2023 年 12 月 31 日本基金不持有关联方发行的债券。（上年度可比期间：无）。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月（含）	新股锁定	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
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	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯动联科	2023 年	1-6 个	科创板	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-

		6月21日	月(含)	打新限售						
301559	中集环科	2023年9月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	1-6个月(含)	创业板打新限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	1-6个月(含)	创业板打新限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301558	三态股份	2023年9月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
688627	精智达	2023年7月11日	1-6个月(含)	科创板打新限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	1-6个月(含)	科创板打新限售	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	1-6个月(含)	创业板打新限售	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	1-6个月(含)	创业板打新限售	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	1-6个月(含)	创业板打新限售	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	1-6个月(含)	科创板打新限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-

301393	昊帆生物	2023年7月5日	1-6个月(含)	创业板打新限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	1-6个月(含)	科创板打新限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
301510	固高科技	2023年8月4日	1-6个月(含)	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301507	民生健康	2023年8月24日	1-6个月(含)	创业板打新限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	1-6个月(含)	科创板打新限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	1-6个月(含)	科创板打新限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	1-6个月(含)	创业板打新限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
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	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	创业板打新限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301499	维科精密	2023年7月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
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	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	1-6个月(含)	创业板打新限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023年7月5日	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023年8月3日	1-6个月(含)	创业板打新限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
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	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

		日		售						
301202	朗威股份	2023年 6月28 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
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	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023年 9月13 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301500	飞南资源	2023年 9月13 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌科技	2023年 8月10 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301469	恒达新材	2023年 8月10 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023年 7月19 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023年 7月26 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万邦医药	2023年 9月18 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023年 7月4 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688573	信宇人	2023年 8月9 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
301489	思泉新材	2023年 10月16 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023年 7月19 日	1-6个 月(含)	科创板 打新限 售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023年 10月9 日	1-6个 月(含)	创业板 打新限 售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301548	崇德科技	2023年	1-6个	创业板	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-

		9月11日	月(含)	打新限售						
688657	浩辰软件	2023年9月25日	1-6个月(含)	科创板打新限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	1-6个月(含)	科创板打新限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688693	锆威特	2023年8月10日	1-6个月(含)	科创板打新限售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	1-6个月(含)	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023年8月7日	1-6个月(含)	创业板打新限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	1-6个月(含)	创业板打新限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	1-6个月(含)	创业板打新限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	1-6个月(含)	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
688450	光格科技	2023年7月17日	1-6个月(含)	科创板打新限售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	1-6个月(含)	新股锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	1-6个月(含)	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-

603075	热威股份	2023年 9月1 日	1-6个 月(含)	新股锁 定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603276	恒兴新材	2023年 9月18 日	1-6个 月(含)	新股锁 定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币305,570,013.78元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
09221800 1	22农发清 发01	2024年1月 2日	101.99	30,000	3,059,784.66
09221800 3	22农发清 发03	2024年1月 2日	101.30	80,000	8,104,262.30
09221800 5	22农发清 发05	2024年1月 2日	100.38	400,000	40,153,355.19
09231800 2	23农发清 发02	2024年1月 2日	102.35	300,000	30,705,590.16
10238210 7	23中电投 MTN035A	2024年1月 2日	100.96	239,000	24,128,358.62
10238237 3	23中电投 MTN037(能源保供 特别债)	2024年1月 2日	101.17	400,000	40,467,444.81

2028022	20 民生银行二级	2024 年 1 月 3 日	102.81	500,000	51,407,295.08
210409	21 农发 09	2024 年 1 月 3 日	100.11	700,000	70,078,788.46
2128025	21 建设银行二级 01	2024 年 1 月 3 日	102.98	300,000	30,892,770.49
2128042	21 兴业银行二级 02	2024 年 1 月 3 日	102.41	253,000	25,910,429.55
合计	-	-	-	3,202,000	324,908,079.32

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期 2023 年 12 月 31 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 250,027,158.94 元，于 2024 年 1 月 2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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浙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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,068,561.64
合计	-	10,068,561.64

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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,940,103.74	-
合计	9,940,103.74	-

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	1,113,774,375.31	269,208,865.85
AAA 以下	379,947,468.62	284,823,967.03
未评级	200,139,362.89	292,807,239.52
合计	1,693,861,206.82	846,840,072.40

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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 555,703,193.97 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,611,653.94	-	-	-	16,611,653.94
结算备付金	7,813,360.93	-	-	-	7,813,360.93
存出保证金	762,736.12	-	-	-	762,736.12

交易性金融资产	215,446,043.28	1,488,355,267.28	-	671,386,147.95	2,375,187,458.51
买入返售金融资产	40,008,921.73	-	-	-	40,008,921.73
应收申购款	-	-	-	2,503,412.60	2,503,412.60
应收清算款	-	-	-	46,696,963.60	46,696,963.60
资产总计	280,642,716.00	1,488,355,267.28	-	720,586,524.15	2,489,584,507.43
负债					
卖出回购金融资产款	555,597,172.72	-	-	-	555,597,172.72
应付赎回款	-	-	-	4,462,623.07	4,462,623.07
应付管理人报酬	-	-	-	1,477,916.29	1,477,916.29
应付托管费	-	-	-	184,739.54	184,739.54
应付销售服务费	-	-	-	361,427.68	361,427.68
应交税费	-	-	-	33,747.10	33,747.10
应付清算款	-	-	-	239,854.68	239,854.68
其他负债	-	-	-	857,082.59	857,082.59
负债总计	555,597,172.72	-	-	7,617,390.95	563,214,563.67
利率敏感度缺口	-274,954,456.72	1,488,355,267.28	-	712,969,133.20	1,926,369,943.76
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					
货币资金	36,338,794.39	-	-	-	36,338,794.39
结算备付金	780,573.40	-	-	-	780,573.40
存出保证金	523,038.66	-	-	-	523,038.66
交易性金融资产	293,398,569.03	553,136,404.19	10,373,660.82	222,079,747.75	1,078,988,381.79
应收申购款	-	-	-	6,048,875.04	6,048,875.04
应收清算款	-	-	-	216,376.84	216,376.84
资产总计	331,040,975.48	553,136,404.19	10,373,660.82	228,344,999.63	1,122,896,040.12
负债					
卖出回购金融资产款	130,128,152.71	-	-	-	130,128,152.71
应付赎回款	-	-	-	189,559.40	189,559.40
应付管理人报酬	-	-	-	643,635.09	643,635.09
应付托管费	-	-	-	80,454.39	80,454.39
应付销售服务费	-	-	-	103,336.53	103,336.53
应交税费	-	-	-	37,013.63	37,013.63
其他负债	-	-	-	822,488.96	822,488.96
负债总计	130,128,152.71	-	-	1,876,488.00	132,004,640.71
利率敏感度缺口	200,912,822.77	553,136,404.19	10,373,660.82	226,468,511.63	990,891,399.41

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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-7,436,307.91	-3,137,055.75
2.市场利率平行下降 25 个基点	7,488,991.57	3,160,794.26	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	671,386,147.95	34.85	222,079,747.75	22.41
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	671,386,147.95	34.85	222,079,747.75	22.41

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	50,102,191.29	17,167,874.90
	2.业绩比较基准下降 5%	-50,102,191.29	-17,167,874.90

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	670,339,603.71	217,330,329.51
第二层次	1,703,800,255.29	860,487,978.89
第三层次	1,047,599.51	1,170,073.39
合计	2,375,187,458.51	1,078,988,381.79

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,170,073.39	1,170,073.39
当期购买	-	2,399,000.16	2,399,000.16
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,876,083.30	2,876,083.30
当期利得或损失总额	-	354,609.26	354,609.26
其中：计入损益的利得或损失	-	354,609.26	354,609.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,047,599.51	1,047,599.51
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	48,549.57	48,549.57
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,138,792.97	1,138,792.97
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	31,280.42	31,280.42
其中：计入损益的利得或损失	-	31,280.42	31,280.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,170,073.39	1,170,073.39
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	31,280.42	31,280.42

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,047,599.51	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-194.82%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,170,073.39	平均价格亚式期权模型	预期波动率	21.27%-247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	671,386,147.95	26.97
	其中：股票	671,386,147.95	26.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,703,801,310.56	68.44
	其中：债券	1,703,801,310.56	68.44

	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	40,008,921.73	1.61
	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	24,425,014.87	0.98
8	其他资产	49,963,112.32	2.01
9	合计	2,489,584,507.43	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	29,735,346.00	1.54
B	采矿业	5,650,208.00	0.29
C	制造业	422,988,179.24	21.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,240,350.84	0.22
E	建筑业	19,647,138.00	1.02
F	批发和零售业	10,211,676.19	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	32,738,616.00	1.70
H	住宿和餐饮业	18,200,424.00	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,541,626.03	0.65
J	金融业	30,027,826.00	1.56
K	房地产业	22,004,354.00	1.14
L	租赁和商务服务业	36,083,700.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	15,385.54	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,002.11	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,890,716.00	0.98
R	文化、体育和娱乐业	8,391,600.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	671,386,147.95	34.85

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300750	宁德时代	146,200	23,868,612.0 0	1.24
2	601012	隆基绿能	1,011,700	23,167,930.0 0	1.20
3	600887	伊利股份	837,400	22,400,450.0 0	1.16
4	002352	顺丰控股	553,755	22,371,702.0 0	1.16
5	601888	中国中免	259,600	21,725,924.0 0	1.13
6	000063	中兴通讯	747,000	19,780,560.0 0	1.03
7	600258	首旅酒店	1,165,200	18,200,424.0 0	0.94
8	002714	牧原股份	412,400	16,982,632.0 0	0.88
9	600486	扬农化工	253,310	15,988,927.2 0	0.83
10	002812	恩捷股份	270,700	15,381,174.0 0	0.80
11	002179	中航光电	384,782	15,006,498.0 0	0.78
12	002027	分众传媒	2,271,800	14,357,776.0 0	0.75
13	002738	中矿资源	379,335	14,152,988.8 5	0.73
14	600048	保利发展	1,425,800	14,115,420.00	0.73
15	002299	圣农发展	742,300	12,752,714.0 0	0.66
16	002368	太极股份	422,300	12,470,519.0 0	0.65
17	603345	安井食品	118,700	12,417,207.0 0	0.64
18	600030	中信证券	592,600	12,071,262.0 0	0.63
19	002430	杭氧股份	406,100	11,862,181.00	0.62
20	300274	阳光电源	131,300	11,500,567.00	0.60
21	002241	歌尔股份	541,400	11,374,814.00	0.59
22	002493	荣盛石化	1,082,200	11,200,770.00	0.58
23	601318	中国平安	268,300	10,812,490.0	0.56

				0	
24	300763	锦浪科技	150,200	10,498,980.0 0	0.55
25	600309	万华化学	134,200	10,309,244.0 0	0.54
26	601607	上海医药	608,200	10,175,186.0 0	0.53
27	002271	东方雨虹	529,000	10,156,800.0 0	0.53
28	300015	爱尔眼科	640,300	10,129,546.0 0	0.53
29	601669	中国电建	2,068,200	10,113,498.00	0.53
30	601369	陕鼓动力	1,211,800	9,670,164.00	0.50
31	600009	上海机场	291,100	9,542,258.00	0.50
32	601117	中国化学	1,499,000	9,533,640.00	0.49
33	603369	今世缘	188,300	9,179,625.00	0.48
34	002850	科达利	106,000	8,952,760.00	0.46
35	300601	康泰生物	324,200	8,802,030.00	0.46
36	600763	通策医疗	114,600	8,761,170.00	0.45
37	000568	泸州老窖	48,500	8,701,870.00	0.45
38	300737	科顺股份	1,369,900	8,411,186.00	0.44
39	300413	芒果超媒	333,000	8,391,600.00	0.44
40	002459	晶澳科技	404,500	8,381,240.00	0.44
41	600600	青岛啤酒	110,500	8,259,875.00	0.43
42	002709	天赐材料	324,100	8,128,428.00	0.42
43	001979	招商蛇口	827,800	7,888,934.00	0.41
44	601677	明泰铝业	692,300	7,850,682.00	0.41
45	002984	森麒麟	255,400	7,368,290.00	0.38
46	000651	格力电器	227,300	7,312,241.00	0.38
47	603236	移远通信	135,220	7,268,075.00	0.38
48	300850	新强联	203,200	6,467,856.00	0.34
49	603806	福斯特	265,400	6,441,258.00	0.33
50	603517	绝味食品	224,700	6,035,442.00	0.31
51	002508	老板电器	272,200	5,928,516.00	0.31
52	600399	抚顺特钢	594,200	5,775,624.00	0.30
53	002155	湖南黄金	507,200	5,650,208.00	0.29
54	300673	佩蒂股份	403,400	5,365,220.00	0.28
55	600884	杉杉股份	381,700	5,198,754.00	0.27
56	600690	海尔智家	234,700	4,928,700.00	0.26
57	600905	三峡能源	970,332	4,240,350.84	0.22
58	000876	新希望	448,800	4,182,816.00	0.22
59	600176	中国巨石	424,200	4,169,886.00	0.22
60	601601	中国太保	163,800	3,895,164.00	0.20

61	601238	广汽集团	429,380	3,757,075.00	0.20
62	603486	科沃斯	88,500	3,667,440.00	0.19
63	000858	五粮液	24,500	3,437,595.00	0.18
64	600132	重庆啤酒	51,500	3,422,175.00	0.18
65	601628	中国人寿	114,600	3,248,910.00	0.17
66	300871	回盛生物	219,600	3,175,416.00	0.16
67	002832	比音勒芬	63,700	2,019,290.00	0.10
68	601333	广深铁路	318,400	824,656.00	0.04
69	301291	明阳电气	12,054	341,851.44	0.02
70	688576	西山科技	2,395	230,231.35	0.01
71	688719	爱科赛博	1,939	123,723.30	0.01
72	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
73	688472	阿特斯	6,261	79,076.43	0.00
74	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
75	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
76	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
77	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
78	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
79	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
80	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
81	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
82	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
83	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
84	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
85	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
86	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
87	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
88	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
89	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
90	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
91	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
92	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
93	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
94	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
95	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
96	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
97	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
98	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
99	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
100	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
101	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
102	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
103	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00

104	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
105	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
106	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
107	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
108	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
109	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
110	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
111	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
112	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
113	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
114	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
115	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
116	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
117	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
118	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
119	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
120	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
121	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
122	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
123	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
124	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
125	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
126	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
127	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
128	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
129	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
130	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
131	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
132	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
133	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
134	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
135	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
136	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
137	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
138	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
139	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
140	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
141	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
142	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	120,245,427.00	12.14
2	002415	海康威视	74,767,010.50	7.55
3	002271	东方雨虹	67,871,293.00	6.85
4	002352	顺丰控股	61,393,303.22	6.20
5	300413	芒果超媒	53,920,265.50	5.44
6	000063	中兴通讯	51,519,268.00	5.20
7	002027	分众传媒	51,031,569.40	5.15
8	601318	中国平安	49,574,332.96	5.00
9	600048	保利发展	49,106,906.00	4.96
10	603345	安井食品	48,054,290.00	4.85
11	002475	立讯精密	47,523,271.00	4.80
12	002493	荣盛石化	44,656,447.22	4.51
13	002459	晶澳科技	42,968,104.00	4.34
14	002179	中航光电	41,774,265.24	4.22
15	000100	TCL 科技	41,029,416.40	4.14
16	000858	五粮液	40,930,346.00	4.13
17	000568	泸州老窖	40,018,512.00	4.04
18	300760	迈瑞医疗	39,866,271.00	4.02
19	601888	中国中免	38,793,424.00	3.92
20	600309	万华化学	38,457,812.00	3.88
21	002463	沪电股份	37,429,378.75	3.78
22	002371	北方华创	37,038,232.00	3.74
23	002299	圣农发展	34,081,104.00	3.44
24	601012	隆基绿能	34,064,674.00	3.44
25	000333	美的集团	33,813,292.00	3.41
26	002709	天赐材料	33,719,222.00	3.40
27	300037	新宙邦	33,541,703.00	3.39
28	002430	杭氧股份	33,242,060.00	3.35
29	600011	华能国际	32,828,899.00	3.31
30	000651	格力电器	32,121,824.00	3.24
31	600872	中炬高新	31,388,289.52	3.17
32	002714	牧原股份	31,296,656.00	3.16
33	000708	中信特钢	29,953,136.20	3.02
34	600893	航发动力	29,534,347.00	2.98
35	002984	森麒麟	29,507,646.00	2.98
36	600258	首旅酒店	29,172,097.58	2.94
37	002812	恩捷股份	28,256,789.00	2.85
38	300274	阳光电源	27,459,932.65	2.77
39	600887	伊利股份	27,275,949.00	2.75
40	300059	东方财富	26,902,146.00	2.71

41	600941	中国移动	25,590,323.82	2.58
42	001979	招商蛇口	24,760,012.00	2.50
43	300408	三环集团	24,698,655.00	2.49
44	600276	恒瑞医药	24,660,723.70	2.49
45	002155	湖南黄金	24,462,486.00	2.47
46	601628	中国人寿	23,624,321.00	2.38
47	300294	博雅生物	23,040,962.74	2.33
48	002738	中矿资源	22,318,424.37	2.25
49	600009	上海机场	20,895,012.20	2.11
50	300015	爱尔眼科	20,193,422.94	2.04
51	002555	三七互娱	20,031,807.48	2.02

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	93,835,813.10	9.47
2	002415	海康威视	93,400,132.50	9.43
3	300413	芒果超媒	56,859,264.08	5.74
4	002271	东方雨虹	56,573,159.00	5.71
5	000100	TCL 科技	50,565,767.04	5.10
6	002475	立讯精密	48,780,744.00	4.92
7	000333	美的集团	46,768,810.00	4.72
8	601318	中国平安	44,965,938.52	4.54
9	300760	迈瑞医疗	44,557,101.00	4.50
10	002027	分众传媒	43,757,107.80	4.42
11	000063	中兴通讯	43,540,227.00	4.39
12	002463	沪电股份	39,098,378.26	3.95
13	002371	北方华创	39,030,718.00	3.94
14	000858	五粮液	38,415,935.00	3.88
15	002352	顺丰控股	36,647,985.48	3.70
16	000651	格力电器	36,516,169.00	3.69
17	002459	晶澳科技	35,860,697.20	3.62
18	300037	新宙邦	34,684,722.41	3.50
19	600048	保利发展	34,517,782.00	3.48
20	600893	航发动力	33,354,402.00	3.37
21	600011	华能国际	33,288,758.39	3.36
22	002493	荣盛石化	32,736,453.84	3.30
23	603345	安井食品	32,589,458.00	3.29
24	600872	中炬高新	32,165,233.90	3.25
25	000568	泸州老窖	31,105,172.00	3.14
26	000708	中信特钢	30,463,993.85	3.07

27	600031	三一重工	30,377,475.00	3.07
28	600276	恒瑞医药	28,219,903.88	2.85
29	300059	东方财富	27,294,672.00	2.75
30	300294	博雅生物	27,110,693.80	2.74
31	002179	中航光电	27,000,789.60	2.72
32	600309	万华化学	26,913,258.00	2.72
33	600941	中国移动	26,081,205.05	2.63
34	300408	三环集团	25,364,026.00	2.56
35	002709	天赐材料	25,258,885.00	2.55
36	002984	森麒麟	22,630,990.00	2.28
37	002438	江苏神通	21,810,480.86	2.20
38	300119	瑞普生物	21,366,591.10	2.16
39	002555	三七互娱	21,099,865.76	2.13
40	002430	杭氧股份	21,077,255.00	2.13
41	002011	盾安环境	21,075,515.55	2.13
42	001323	慕思股份	20,307,816.74	2.05
43	601628	中国人寿	19,864,312.00	2.00

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。

8.4.3 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	2,812,786,872.39
卖出股票收入（成交）总额	2,291,938,610.04

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,414,997,915.88	73.45
	其中：政策性金融债	154,141,637.21	8.00
4	企业债券	47,484,637.86	2.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	231,377,597.81	12.01
7	可转债（可交换债）	1,055.27	0.00
8	同业存单	9,940,103.74	0.52
9	其他	-	-
10	合计	1,703,801,310.56	88.45

8.6 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	185891	22 安信 C1	1,680,000	171,099,346.86	8.88
2	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	900,000	97,699,868.85	5.07
3	102300475	23 华能 MTN014	700,000	70,858,666.67	3.68
4	210409	21 农发 09	700,000	70,078,788.46	3.64
5	212380006	23 华夏银行债 02	600,000	61,064,852.46	3.17

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局（原中国银行保险监督管理委员会）处罚的情况；中信证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行处罚的情况；

华泰证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局江苏省分局、中国人民银行江苏省分行处罚的情况。

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

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

8.12.2

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。

8.12.3 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	762,736.12
2	应收清算款	46,696,963.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,503,412.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,963,112.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123119	康泰转 2	1,055.27	-

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------	-------

	(户)	基金份额	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
创金合信鑫祺混合 A	40,428	20,830.69	628,689,816.33	74.65%	213,453,157.69	25.35%
创金合信鑫祺混合 C	82,170	10,185.48	358,909,859.65	42.88%	478,031,342.06	57.12%
合计	118,941	14,116.95	987,599,675.98	58.82%	691,484,499.75	41.18%

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）。

9.2 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	创金合信鑫祺混合 A	1,983,046.96	0.24%
	创金合信鑫祺混合 C	556,116.51	0.07%
	合计	2,539,163.47	0.15%

9.3 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的情况

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	创金合信鑫祺混合 A	50~100
	创金合信鑫祺混合 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信鑫祺混合 A	50~100
	创金合信鑫祺混合 C	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信鑫祺混合 A	创金合信鑫祺混合 C
基金合同生效日(2020年3月4日)基金份额总额	200,103,475.18	3,970.71
本报告期期初基金份额总额	585,809,717.77	288,128,836.74
本报告期基金总申购份额	1,354,820,574.03	1,687,665,510.10
减：报告期基金总赎回份额	1,098,487,317.78	1,138,853,145.1

		3
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	842,142,974.02	836,941,201.71

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2023 年 7 月 26 日起，彭兴韵先生担任公司独立董事，王勇先生不再担任公司独立董事；

2023 年 7 月 26 日起，黄先智先生担任公司董事，黄越岷先生不再担任公司董事；

2023 年 7 月 26 日起，梁绍锋先生担任公司董事会秘书。

基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 72,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
长江证券	2	657,959,904.97	12.95%	485,685.52	13.11%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	4,422,857,240.44	87.05%	3,218,104.86	86.89%	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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长江证券 2 个交易单元、中邮证券 2 个交易单元。

11.7.2 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
长江证券	472,949,477.10	44.99%	1,588,000,000.00	32.57%	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	578,190,111.51	55.01%	3,287,200,000.00	67.43%	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 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、上海证券报、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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
4	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 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
5	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 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
6	创金合信鑫祺混合型证券投资基金（2023 年 7 月）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-13
7	创金合信鑫祺混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-13
8	创金合信鑫祺混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-13
9	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-20
10	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2023 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
11	创金合信基金管理有限公司关于暂停凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-02
12	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式基金不参加交通银行费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-09
13	创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-24
14	创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫祺混合型证券投资基金的关联交易公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
15	创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫祺混合型证券投资基金的关联交易公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-18

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫祺混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫祺混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫祺混合型证券投资基金 2023 年度报告原文。

13.2 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

13.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日