

# 创金合信消费主题股票型证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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，普华永道中天会计师事务所（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.....	10
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.....	14
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.....	18
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12	投资组合报告附注	60
§9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§10	开放式基金份额变动	62
§11	重大事件揭示	63
11.1	基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4	基金投资策略的改变	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8	其他重大事件	65
§12	影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	67
§13	备查文件目录	67
13.1	备查文件目录	67
13.2	存放地点	67
13.3	查阅方式	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信消费主题股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信消费主题股票	
基金主代码	003190	
交易代码	003190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 11 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	76,773,499.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C
下属分级基金的交易代码	003190	003191
报告期末下属分级基金的份 额总额	16,281,670.24 份	60,491,828.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关的优质上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*90%+人民币活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限 公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.c om
客户服务电话	400-868-0666	400-61-95555

传真	0755-25832571	0755-83195201
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）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518052	518040
法定代表人	钱龙海	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
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、创金合信消费主题股票 A

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-3,664,809.81	-7,870,413.29	4,197,426.38
本期利润	-9,645,351.47	-4,129,769.13	-1,332,396.22
加权平均基金份额本期利润	-0.3772	-0.1610	-0.0745
本期加权平均净值利润率	-15.74%	-6.68%	-2.63%
本期基金份额净值增长率	-16.76%	-13.19%	-
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	4,526,926.13	21,358,710.66	19,006,950.67
期末可供分配基金份额利润	0.2780	0.5555	0.8650
期末基金资产净值	33,188,739.78	94,150,235.62	61,980,738.46
期末基金份额净值	2.0384	2.4487	2.8206
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	103.78%	144.79%	181.97%

##### 2、创金合信消费主题股票 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-21,194,264.16	-24,639,964.60	9,230,431.46
本期利润	-38,660,204.12	-21,534,727.47	-1,192,293.44
加权平均基金份额本期利润	-0.3876	-0.2557	-0.0177
本期加权平均净值利润率	-16.93%	-10.83%	-0.64%
本期基金份额净值增长率	-17.34%	-13.79%	-0.70%
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	11,767,403.83	53,512,990.44	65,871,524.16
期末可供分配基金份额利润	0.1945	0.4774	0.7953
期末基金资产净值	118,673,004.00	266,010,730.68	228,014,678.20
期末基金份额净值	1.9618	2.3732	2.7529
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	96.01%	137.11%	175.05%

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

创金合信消费主题股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.79%	0.92%	-5.77%	0.88%	-4.02%	0.04%
过去六个月	-8.87%	0.95%	-7.26%	0.93%	-1.61%	0.02%
过去一年	-16.76%	1.00%	-13.01%	0.95%	-3.75%	0.05%
过去三年	-27.73%	1.61%	-34.32%	1.33%	6.59%	0.28%
过去五年	114.39%	1.61%	54.74%	1.35%	59.65%	0.26%
自基金合同生效起至今	103.78%	1.57%	41.56%	1.37%	62.22%	0.20%

创金合信消费主题股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.96%	0.92%	-5.77%	0.88%	-4.19%	0.04%
过去六个月	-9.20%	0.95%	-7.26%	0.93%	-1.94%	0.02%
过去一年	-17.34%	1.00%	-13.01%	0.95%	-4.33%	0.05%
过去三年	-29.23%	1.61%	-34.32%	1.33%	5.09%	0.28%
过去五年	106.64%	1.61%	54.74%	1.35%	51.90%	0.26%
自基金合同生效起至今	96.01%	1.57%	41.56%	1.37%	54.45%	0.20%

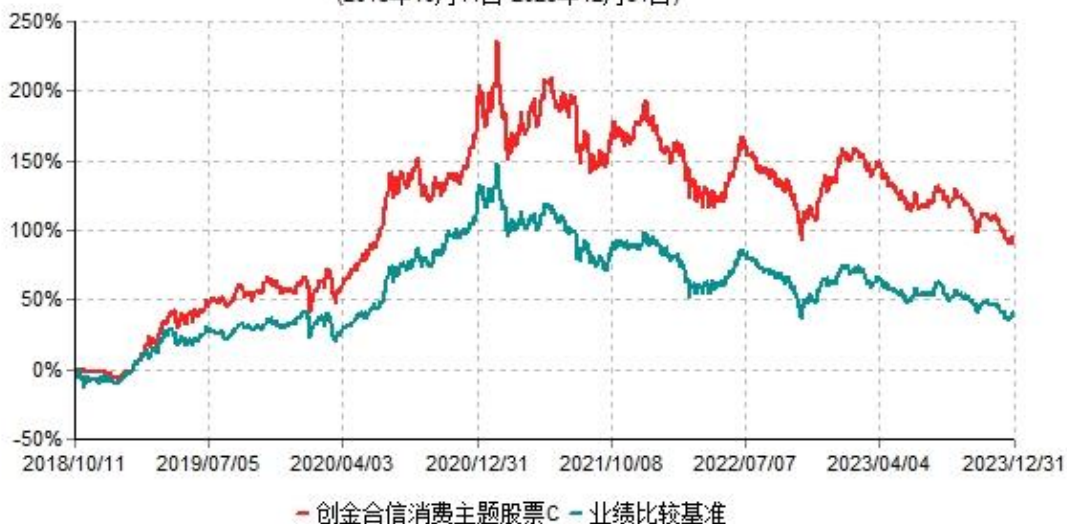
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



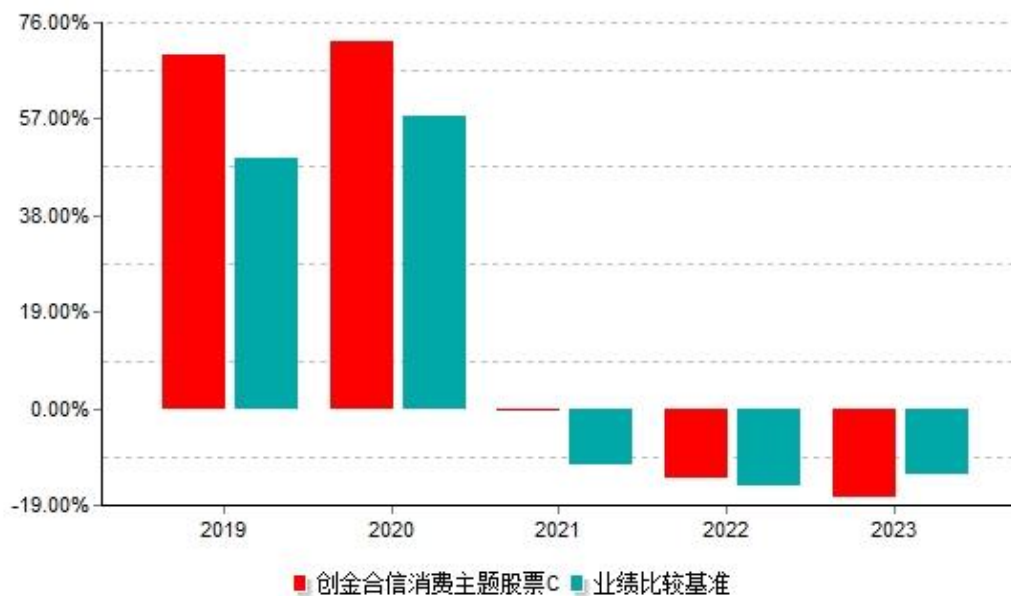
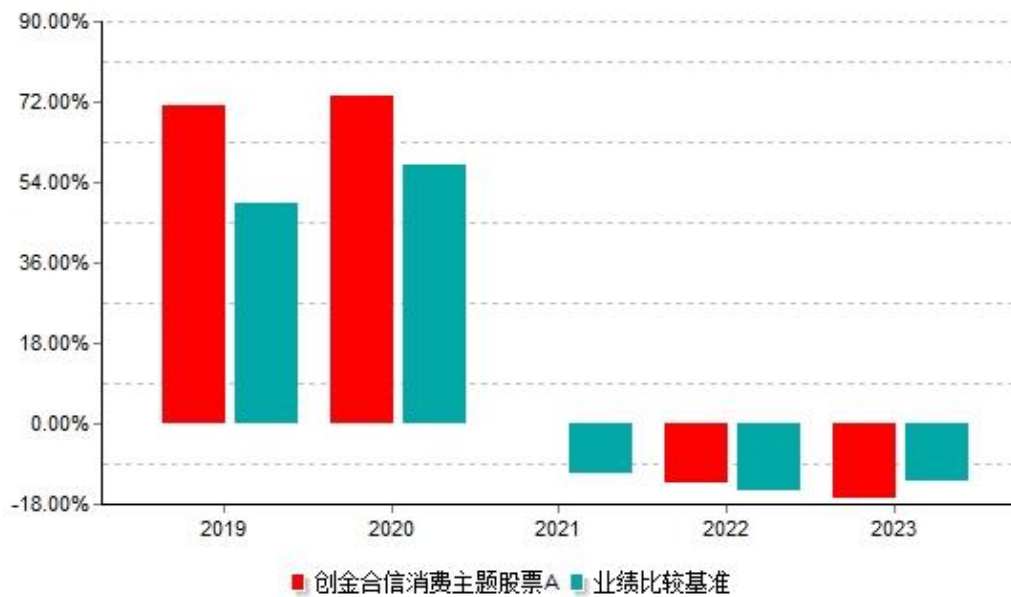
创金合信消费主题股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年10月11日-2023年12月31日)



创金合信消费主题股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年10月11日-2023年12月31日)



### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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		
陈建军	本基金基金经理	2019 年 5 月 30 日	-	10	陈建军女士，中国国籍，硕士。2009 年 1 月加入茂业国际控股有限公司，任投资者关系部信息披露经理，2013 年 7 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理部研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，任研究部研究员，2015 年 6 月加入第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部、资产管理运营部投资主办，2019 年 4 月加入创金合信基金管理有限公司，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 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

所有投资对象的投资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

回顾 2023 年，消费板块仅在一季度有较好表现，但那也是属于 2022 年第四季度超跌反弹的尾声，当时市场对防疫放开后的 2023 年消费复苏充满期待，同时在年初也对美元加息提前结束以及以美债为代表的无风险收益率下降有较高预期。虽然我们对一季度整个板块的大幅反弹已经很谨慎并且已经做出相应减仓，但当时也只是认为板块是阶段性调整，在等待消费基本面复苏的确认。彼时，我们认为进入三季度，板块能在调整完后，再由消费复苏基本面确认而驱动继续向上走，但是，整个下半年的表现恰与我们预期恰恰相反。

问题出在哪里？消费没有复苏？并不尽然。本着见微知著，2023 年我们陆续做了较多调研，根据调研信息和部分消费数据验证，我们认为终端消费情况比起市场极度悲观的情绪要好，至少是有结构性分化。其中以基础消费、大众休闲文化消费为代表的消费表现其实可圈可点，而中档消费的确不及预期。基于此，我们也及时对组合配置作了相应调整，降低了中高档价格带的消费板块，比如免税和医美，增加了基础价格带的消费板块，比如中低端白酒和景区及品牌中药。这些调整事后看是正确的，但是进入四季度末，这些短期基本面有相对优势的子板块并未能幸免于补跌。

问题又出在哪？而纵观全年，全市场表现最好的板块无疑是煤炭，而消费板块里是大家电、纺织。这些行业的具有某些共同特点，即行业竞争格局稳定，现金流入稳健且分红率高，绝对估值低，因为市场曾把这一类定义未来成长性不足的行业。尤其是 2024 开年以来的进步一反差的走势，让我们不得不反省，问题是不是出在我们过去带有肌肉记忆的成长模型框架。一般情况下，当成长型经济体在逐步转向成熟型经济体时，投资框架也相应

调整。过去依靠资本开支拉动净利润增长的决策模式可能要逐渐让位于更看重投入产出回报率的决策模式。我们已逐渐感知到，过去两年资本市场的定价机制已悄悄从过去的单纯从净利润单一指标，转向更加看重股东回报的自由现金流。

从上述的宏观回到我们消费板块的投资，在国内经济仍处于夯实基础的阶段，至少我们应该把投资框架设定在需求端放缓的大背景里，然后去寻找格局处于改善通道，自由现金流有望改善、股东回报显著改善的细分行业和公司，这可能是未来一段时间内最核心的投资思路。基于此，2024 年消费板块的配置，我们偏向于看重股东回报、自由现金流好且绝对估值较低的子板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信消费主题股票 A 基金份额净值为 2.0384 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.76%，同期业绩比较基准收益率为-13.01%；截至本报告期末创金合信消费主题股票 C 基金份额净值为 1.9618 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.34%，同期业绩比较基准收益率为-13.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，宏观经济将以稳增长为主基调，而消费是拉动 GDP 增长最重要的一驾马车，故而我们乐观地预计宏观环境将会积极地呵护消费。所以我们对消费的持续复苏并不悲观。而经过的三年的持续调整，消费板块估值具有一定的吸引力，但对竞争壁垒较弱，依靠持续融资推动扩张的板块以及竞争格局趋向恶化的板块保持非常警惕的态度。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 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	普华永道中天审字(2024)第 20821 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	创金合信消费主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了创金合信消费主题股票型证券投资基金(以下简称“创金合信消费主题股票基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了创金合信消费主题股票基金 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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于创金合信消费主题股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>创金合信消费主题股票基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估创金合信消费主题股票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，除非基金管理人管理层计划清算创金合信消费主题股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督创金合信消费主题股票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>(一)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>(二)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>(三)评价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>(四)对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,就可能对导致对创金合信消费主题股票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创金合信消费主题股票基金不能持续经营。</p> <p>(五)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。我们与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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曹翠丽	李崇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2024年3月25日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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	29,495,286.17	36,472,266.22
结算备付金		1,179,622.35	21,715,190.35
存出保证金		151,358.37	112,722.49
交易性金融资产	7.4.7.2	122,082,540.16	312,138,509.08
其中：股票投资		122,082,540.16	312,138,509.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		4,160,164.26	-
应收股利		-	-
应收申购款		155,404.43	454,109.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		157,224,375.74	370,892,797.71
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		-	-
应付清算款		4,087,759.36	8,962,287.31
应付赎回款		169,118.09	223,061.62
应付管理人报酬		155,514.26	456,981.79
应付托管费		25,919.03	60,930.89
应付销售服务费		70,753.67	159,220.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	853,567.55	869,349.63
负债合计		5,362,631.96	10,731,831.41
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	81,173,928.78	159,109,922.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	70,687,815.00	201,051,043.56
净资产合计		151,861,743.78	360,160,966.30
负债和净资产总计		157,224,375.74	370,892,797.71

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，创金合信消费主题股票 A 份额净值 2.0384 元，基金份额总额 16,281,670.24 份；创金合信消费主题股票 C 份额净值 1.9618 元，基金份额总额 60,491,828.88 份；总份额合计 76,773,499.12 份。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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		-41,739,105.67	-19,672,253.29
1.利息收入		214,519.06	138,249.18
其中：存款利息收入	7.4.7.9	214,519.06	138,249.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,642,154.54	-27,052,889.94
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-22,627,503.41	-29,613,131.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
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	3,985,348.87	2,560,241.18
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	-23,446,481.62	6,845,881.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	135,011.43	396,506.18
减：二、营业总支出		6,566,449.92	5,992,243.31
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	4,181,778.03	3,896,317.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	584,954.89	519,509.00
3.销售服务费	7.4.10.2.3	1,614,161.56	1,387,223.24
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6.信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.18	185,555.44	189,193.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,305,555.59	-25,664,496.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,305,555.59	-25,664,496.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,305,555.59	-25,664,496.60

### 7.3 净资产变动表

会计主体：创金合信消费主题股票型证券投资基金

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	159,109,922.74	-	201,051,043.56	360,160,966.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	159,109,922.74	-	201,051,043.56	360,160,966.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,935,993.96	-	-130,363,228.56	-208,299,222.52
（一）、综合收益总额	-	-	-48,305,555.59	-48,305,555.59
（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）	-77,935,993.96	-	-82,057,672.97	-159,993,666.93
其中：1.基金申购款	50,971,173.47	-	64,028,440.86	114,999,614.33
2.基金赎回款	-128,907,167.43	-	-146,086,113.83	-274,993,281.26

(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	81,173,928.78	-	70,687,815.00	151,861,743.78
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	110,810,263.17	-	179,185,153.49	289,995,416.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	110,810,263.17	-	179,185,153.49	289,995,416.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	48,299,659.57	-	21,865,890.07	70,165,549.64
(一)、综合收益总额	-	-	-25,664,496.60	-25,664,496.60
(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)	48,299,659.57	-	47,530,386.67	95,830,046.24
其中：1.基金申购款	154,996,733.21	-	185,219,311.84	340,216,045.05
2.基金赎回款	-106,697,073.64	-	-137,688,925.17	-244,385,998.81
(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	159,109,922.74	-	201,051,043.56	360,160,966.30

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

创金合信消费主题股票型证券投资基金是由原创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“创金合信鑫回报混合基金”)转型而来。根据原创金合信鑫回报混合基金基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，创金合信鑫回报混合基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于 2018 年 9 月 27 日发布了《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据《关于创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)协商一致，自 2018 年 10 月 11 日起，原创金合信鑫回报混合基金名称变更为创金合信消费主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行。根据《创金合信消费主题股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、货币市场工具(含同业存单等)、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中，投资于消费主题的股票不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日

终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应持有不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率 $\times$ 90%+人民币活期存款利率(税后) $\times$ 10%。本财务报表由本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产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。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：



以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于

第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金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。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为:(1)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该类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;(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;(3)同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同,不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同;(4)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人经与基金托管人协商一致后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;(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部

具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：(1)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《中国证监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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税

额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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	29,495,286.17	36,472,266.22
等于：本金	29,492,199.95	36,467,099.27
加：应计利息	3,086.22	5,166.95
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	29,495,286.17	36,472,266.22

#### 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	125,973,914.43	-	122,082,540.16	-3,891,374.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	125,973,914.43	-	122,082,540.16	-3,891,374.27
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	292,583,401.73	-	312,138,509.08	19,555,107.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	292,583,401.73	-	312,138,509.08	19,555,107.35

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 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	12.72	42.23
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	683,554.83	694,307.40
其中：交易所市场	683,554.83	694,307.40
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	175,000.00
合计	853,567.55	869,349.63

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信消费主题股票 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	38,448,742.91	40,397,795.83
本期申购	6,931,186.65	7,282,524.02
本期赎回（以“-”号填列）	-29,098,259.32	-30,573,316.32
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	16,281,670.24	17,107,003.53

创金合信消费主题股票 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	112,087,138.59	118,712,126.91
本期申购	41,250,541.19	43,688,649.45
本期赎回（以“-”号填列）	-92,845,850.90	-98,333,851.11
基金份额折算变动份额	-	-



本期末	60,491,828.88	64,066,925.25
-----	---------------	---------------

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

创金合信消费主题股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,358,710.66	32,393,729.13	53,752,439.79
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,358,710.66	32,393,729.13	53,752,439.79
本期利润	-3,664,809.81	-5,980,541.66	-9,645,351.47
本期基金份额交易产生的变动数	-13,166,974.72	-14,858,377.35	-28,025,352.07
其中：基金申购款	4,113,531.14	5,640,339.39	9,753,870.53
基金赎回款	-17,280,505.86	-20,498,716.74	-37,779,222.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,526,926.13	11,554,810.12	16,081,736.25

创金合信消费主题股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,512,990.44	93,785,613.33	147,298,603.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	53,512,990.44	93,785,613.33	147,298,603.77
本期利润	-21,194,264.16	-17,465,939.96	-38,660,204.12
本期基金份额交易产生的变动数	-20,551,322.45	-33,480,998.45	-54,032,320.90
其中：基金申购款	21,540,200.22	32,734,370.11	54,274,570.33
基金赎回款	-42,091,522.67	-66,215,368.56	-108,306,891.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,767,403.83	42,838,674.92	54,606,078.75

#### 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	144,510.20	118,803.52
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	67,691.34	17,780.12

其他	2,317.52	1,665.54
合计	214,519.06	138,249.18

#### 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	-22,627,503.41	-29,613,131.12
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	-22,627,503.41	-29,613,131.12

##### 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	2,012,860,678.89	1,374,078,578.33
减：卖出股票成本总额	2,030,734,690.07	1,400,164,470.48
减：交易费用	4,753,492.23	3,527,238.97
买卖股票差价收入	-22,627,503.41	-29,613,131.12

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖债券差价收入。

##### 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	3,985,348.87	2,560,241.18
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	3,985,348.87	2,560,241.18

**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	-23,446,481.62	6,845,881.29
——股票投资	-23,446,481.62	6,845,881.29
——债券投资	-	-
——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	-23,446,481.62	6,845,881.29

**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	119,154.92	353,543.69
转换费收入	15,856.51	42,962.49
合计	135,011.43	396,506.18

**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	50,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	15,555.44	14,193.78
合计	185,555.44	189,193.78

### 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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	238,472,864.30	8.54%

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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	172,752.73	9.16%	-	-

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	4,181,778.03	3,896,317.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,277,396.49	1,485,023.24
应支付基金管理人的净管理费	2,904,381.54	2,411,294.05

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 30 日，支付基金管理人创金合信的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。根据本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 30 日发布的《创金合信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 31 日起，支付基金管理人创金合信的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 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	584,954.89	519,509.00

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C	合计
创金合信直销	-	297,295.87	297,295.87
招商银行	-	55,912.27	55,912.27
合计	-	353,208.14	353,208.14
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		
	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C	合计
创金合信直销	-	53,469.03	53,469.03
招商银行	-	73,310.33	73,310.33
合计	-	126,779.36	126,779.36

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 0.7% 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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.7\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
招商银行股份有限公司	29,495,286.17	144,510.20	36,472,266.22	118,803.52

注：本基金的银行存款由基金托管人招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

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 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
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	-
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	458	8,280.64	20,413.06	-
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	-
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	203	9,494.31	17,807.16	-
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	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月(含)	科创板打新限售	26.74	38.67	382	10,214.68	14,771.94	-
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	242	19,115.58	14,638.58	-
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	370	11,592.10	14,119.20	-
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	1,735	8,987.30	14,036.15	-
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	-
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	1,062	10,481.94	13,540.50	-
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	246	18,039.18	12,546.00	-



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	421	16,052.73	11,939.56	-
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	872	6,391.76	11,684.80	-
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	-
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	-
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	-
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	356	8,892.88	9,975.12	-
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	627	6,270.00	9,937.95	-
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	167	11,302.56	9,914.79	-
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	327	15,558.66	9,881.94	-
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	494	13,179.92	9,232.86	-
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	236	12,047.80	9,090.72	-
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	145	8,201.20	9,023.35	-

		日		售						
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	186	7,934.76	8,961.48	-
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	225	8,997.75	8,732.25	-
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	80.80	77.75	111	8,968.80	8,630.25	-
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	267	6,893.94	8,490.60	-
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	244	7,046.72	8,439.96	-
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	-
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	115	8,257.00	7,924.65	-
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	180	6,760.80	7,842.60	-
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	236	8,632.88	7,809.24	-
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	175	4,702.25	7,645.75	-
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	-
688716	中研股份	2023 年	1-6 个	科创板	29.66	36.39	201	5,961.66	7,314.39	-

		9月13日	月(含)	打新限售						
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	-
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	308	7,931.00	7,087.08	-
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	-
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	154	6,287.82	6,685.14	-
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	132	6,848.16	6,626.40	-
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	325	6,802.25	6,568.25	-
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	107	7,487.86	6,430.70	-
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	163	5,965.80	6,174.44	-
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	75	7,467.75	6,109.50	-
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	169	7,909.20	6,095.83	-
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	283	6,783.51	5,911.87	-
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	316	7,653.52	5,763.84	-
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	109	7,398.92	5,748.66	-
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	515	4,459.90	5,695.90	-

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	199	6,200.84	5,625.73	-
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	143	7,962.24	5,373.94	-
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	68	7,031.20	5,319.64	-
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	138	6,526.02	5,239.86	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	66.80	58.99	86	5,744.80	5,073.14	-
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	120	6,370.80	4,370.40	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	1-6个月(含)	新股锁定	31.68	31.27	132	4,181.76	4,127.64	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	1-6个月(含)	新股锁定	21.77	29.58	139	3,026.03	4,111.62	-
603273	天元智能	2023年10月16日	1-6个月(含)	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	1-6个月(含)	新股锁定	49.97	39.70	81	4,047.57	3,215.70	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	1-6个月(含)	新股锁定	15.32	23.87	134	2,052.88	3,198.58	-
603193	润本股份	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股锁定	17.38	16.66	176	3,058.88	2,932.16	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股锁定	25.73	24.88	110	2,830.30	2,736.80	-
603075	热威股份	2023年9月1日	1-6个月(含)	新股锁定	23.10	23.31	112	2,587.20	2,610.72	-

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**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### **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招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**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **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**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **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，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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期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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 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	29,495,286.17	-	-	-	29,495,286.17
结算备付金	1,179,622.35	-	-	-	1,179,622.35
存出保证金	151,358.37	-	-	-	151,358.37
交易性金融资产	-	-	-	122,082,540.16	122,082,540.16
应收申购款	-	-	-	155,404.43	155,404.43
应收清算款	-	-	-	4,160,164.26	4,160,164.26
资产总计	30,826,266.89	-	-	126,398,108.85	157,224,375.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	169,118.09	169,118.09
应付管理人报酬	-	-	-	155,514.26	155,514.26
应付托管费	-	-	-	25,919.03	25,919.03
应付销售服务费	-	-	-	70,753.67	70,753.67
应付清算款	-	-	-	4,087,759.36	4,087,759.36
其他负债	-	-	-	853,567.55	853,567.55
负债总计	-	-	-	5,362,631.96	5,362,631.96
利率敏感度缺口	30,826,266.89	-	-	121,035,476.89	151,861,743.78
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	36,472,266.22	-	-	-	36,472,266.22



结算备付金	21,715,190.35	-	-	-	21,715,190.35
存出保证金	112,722.49	-	-	-	112,722.49
交易性金融资产	-	-	-	312,138,509.08	312,138,509.08
应收申购款	-	-	-	454,109.57	454,109.57
资产总计	58,300,179.06	-	-	312,592,618.65	370,892,797.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	223,061.62	223,061.62
应付管理人报酬	-	-	-	456,981.79	456,981.79
应付托管费	-	-	-	60,930.89	60,930.89
应付销售服务费	-	-	-	159,220.17	159,220.17
应付清算款	-	-	-	8,962,287.31	8,962,287.31
其他负债	-	-	-	869,349.63	869,349.63
负债总计	-	-	-	10,731,831.41	10,731,831.41
利率敏感度缺口	58,300,179.06	-	-	301,860,787.24	360,160,966.30

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 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	122,082,540.16	80.39	312,138,509.08	86.67
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	122,082,540.16	80.39	312,138,509.08	86.67

#### 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%	5,777,556.21	17,184,785.62
	2.业绩比较基准下降 5%	-5,777,556.21	-17,184,785.62

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	121,454,141.09	311,532,034.87
第二层次	-	-
第三层次	628,399.07	606,474.21

合计	122,082,540.16	312,138,509.08
----	----------------	----------------

#### 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	-	606,474.21	606,474.21
当期购买	-	1,322,795.01	1,322,795.01
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,625,876.95	1,625,876.95
当期利得或损失总额	-	325,006.80	325,006.80
其中：计入损益的利得或损失	-	325,006.80	325,006.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	628,399.07	628,399.07
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	-	80,572.54	80,572.54
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	-	672,902.74	672,902.74
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	-	-66,428.53	-66,428.53

其中：计入损益的利得或损失	-	-66,428.53	-66,428.53
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	606,474.21	606,474.21
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	-	-66,428.53	-66,428.53

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	628,399.07	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-219.88%	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	606,474.21	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-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	122,082,540.16	77.65
	其中：股票	122,082,540.16	77.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	30,674,908.52	19.51
8	其他资产	4,466,927.06	2.84
9	合计	157,224,375.74	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	4,700,384.00	3.10
B	采矿业	2,254,736.00	1.48
C	制造业	113,236,458.63	74.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,897.04	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	92,145.39	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	781.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	524,613.09	0.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	89,150.61	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	257,288.54	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,785.86	0.01

R	文化、体育和娱乐业	888,300.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	122,082,540.16	80.39

### 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	600519	贵州茅台	8,100	13,980,600.00	9.21
2	603369	今世缘	247,937	12,086,928.75	7.96
3	002304	洋河股份	106,839	11,741,606.10	7.73
4	600211	西藏药业	232,114	11,327,163.20	7.46
5	603198	迎驾贡酒	168,937	11,198,833.73	7.37
6	600559	老白干酒	447,792	10,097,709.60	6.65
7	603589	口子窖	216,000	9,784,800.00	6.44
8	300119	瑞普生物	565,205	9,263,709.95	6.10
9	600298	安琪酵母	222,995	7,844,964.10	5.17
10	002299	圣农发展	269,400	4,628,292.00	3.05
11	000848	承德露露	476,390	3,739,661.50	2.46
12	603919	金徽酒	144,700	3,562,514.00	2.35
13	000596	古井贡酒	15,107	3,516,909.60	2.32
14	002155	湖南黄金	202,400	2,254,736.00	1.48
15	300871	回盛生物	75,210	1,087,536.60	0.72
16	300144	宋城演艺	90,000	888,300.00	0.58
17	000999	华润三九	7,400	368,002.00	0.24
18	000888	峨眉山A	19,100	170,563.00	0.11
19	688484	南芯科技	3,799	151,390.15	0.10
20	301382	蜂助手	4,080	145,329.60	0.10
21	688552	航天南湖	5,802	136,288.98	0.09
22	688523	航天环宇	4,717	126,509.94	0.08
23	688458	美芯晟	1,637	125,983.52	0.08
24	688543	国科军工	2,047	114,427.30	0.08
25	301332	德尔玛	8,775	107,230.50	0.07
26	688570	天玛智控	3,842	104,540.82	0.07
27	301329	信音电子	4,577	103,682.64	0.07

28	301261	恒工精密	1,973	101,693.80	0.07
29	301509	金凯生科	1,442	90,915.93	0.06
30	688638	誉辰智能	1,401	84,216.48	0.06
31	301550	斯菱股份	1,791	82,560.78	0.05
32	301323	新莱福	2,163	80,009.37	0.05
33	301232	飞沃科技	1,643	79,669.07	0.05
34	688716	中研股份	2,001	78,414.39	0.05
35	002458	益生股份	6,700	72,092.00	0.05
36	301518	长华化学	3,080	71,951.88	0.05
37	000333	美的集团	1,300	71,019.00	0.05
38	301337	亚华电子	2,318	70,953.98	0.05
39	301505	苏州规划	1,934	70,283.14	0.05
40	688719	爱科赛博	1,066	68,017.68	0.04
41	688623	二元科技	947	67,218.06	0.04
42	301519	舜禹股份	3,245	66,837.05	0.04
43	688479	友车科技	2,793	65,132.76	0.04
44	301170	锡南科技	2,090	63,598.70	0.04
45	301376	致欧科技	2,655	63,507.60	0.04
46	688646	逸飞激光	1,685	61,642.07	0.04
47	688361	中科飞测	817	60,809.31	0.04
48	301559	中集环科	3,154	59,288.52	0.04
49	688602	康鹏科技	5,149	57,735.72	0.04
50	301515	港通医疗	1,990	56,884.15	0.04
51	301371	敷尔佳	1,428	54,473.79	0.04
52	688612	威迈斯	1,374	53,382.06	0.04
53	301548	崇德科技	854	51,990.26	0.03
54	688450	光格科技	1,191	43,868.88	0.03
55	603273	天元智能	1,772	43,322.30	0.03
56	301153	中科江南	457	35,769.39	0.02
57	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
58	603119	浙江荣泰	1,340	32,383.78	0.02
59	603193	润本股份	1,753	31,602.02	0.02
60	688435	英方软件	656	31,501.12	0.02
61	603276	恒兴新材	1,096	28,688.32	0.02
62	001324	长青科技	1,131	27,449.37	0.02
63	301383	天键股份	418	27,170.00	0.02
64	603075	热威股份	1,113	26,904.99	0.02
65	301269	华大九天	253	26,780.05	0.02
66	688581	安杰思	179	22,340.99	0.01
67	688469	中芯集成	4,346	21,816.92	0.01
68	603172	万丰股份	1,220	21,508.60	0.01
69	301293	三博脑科	333	20,785.86	0.01
70	301387	光大同创	307	20,783.90	0.01

71	301348	蓝箭电子	458	20,413.06	0.01
72	688472	阿特斯	1,538	19,424.94	0.01
73	688426	康为世纪	625	19,093.75	0.01
74	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.01
75	301307	美利信	518	17,969.42	0.01
76	301120	新特电气	1,548	17,941.32	0.01
77	001376	百通能源	804	17,897.04	0.01
78	688627	精智达	203	17,807.16	0.01
79	688562	航天软件	726	17,424.00	0.01
80	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.01
81	688535	华海诚科	178	16,514.84	0.01
82	688548	广钢气体	1,285	16,452.88	0.01
83	688629	华丰科技	740	16,206.00	0.01
84	301310	鑫宏业	320	15,568.00	0.01
85	688549	中巨芯	1,897	15,393.71	0.01
86	688582	芯动联科	393	15,197.31	0.01
87	301165	锐捷网络	398	15,080.22	0.01
88	301262	海看股份	480	14,952.00	0.01
89	688593	新相微	1,006	14,808.32	0.01
90	688352	顾中科技	957	14,747.37	0.01
91	688563	航材股份	242	14,638.58	0.01
92	688512	慧智微	735	14,325.15	0.01
93	688576	西山科技	149	14,323.37	0.01
94	301172	君逸数码	370	14,119.20	0.01
95	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
96	301317	鑫磊股份	694	13,644.04	0.01
97	600809	山西汾酒	57	13,151.61	0.01
98	688334	西高院	757	13,118.81	0.01
99	688146	中船特气	374	12,719.74	0.01
100	688507	索辰科技	93	12,717.75	0.01
101	688610	埃科光电	246	12,546.00	0.01
102	301360	荣旗科技	134	12,542.40	0.01
103	301330	熵基科技	377	12,478.70	0.01
104	688531	日联科技	122	12,331.76	0.01
105	688573	信宇人	423	12,320.40	0.01
106	301315	威士顿	226	11,946.36	0.01
107	301291	明阳电气	421	11,939.56	0.01
108	301225	恒勃股份	333	11,921.40	0.01
109	301320	豪江智能	642	11,857.74	0.01
110	301558	三态股份	872	11,684.80	0.01
111	688603	天承科技	157	11,654.26	0.01
112	301095	广立微	154	11,508.42	0.01
113	603392	万泰生物	153	11,494.89	0.01



114	301295	美硕科技	346	11,483.74	0.01
115	301292	海科新源	583	11,281.05	0.01
116	301338	凯格精机	270	11,070.00	0.01
117	301097	天益医疗	209	10,999.67	0.01
118	301499	维科精密	371	10,733.03	0.01
119	301389	隆扬电子	557	10,627.56	0.01
120	688631	莱斯信息	300	10,575.00	0.01
121	688620	安凯微	890	10,519.80	0.01
122	688433	华曙高科	336	10,500.00	0.01
123	301187	欧圣电气	520	10,353.20	0.01
124	301429	森泰股份	499	10,199.56	0.01
125	301372	科净源	231	10,069.29	0.01
126	688591	泰凌微	356	9,975.12	0.01
127	301507	民生健康	627	9,937.95	0.01
128	301393	昊帆生物	167	9,914.79	0.01
129	301468	博盈特焊	327	9,881.94	0.01
130	301305	朗坤环境	544	9,819.20	0.01
131	301363	美好医疗	263	9,678.40	0.01
132	000568	泸州老窖	52	9,329.84	0.01
133	301395	仁信新材	494	9,232.86	0.01
134	688651	盛邦安全	200	9,232.22	0.01
135	301362	民爆光电	236	9,090.72	0.01
136	688702	盛科通信	186	8,961.48	0.01
137	301428	世纪恒通	229	8,850.85	0.01
138	301498	乖宝宠物	225	8,732.25	0.01
139	603296	华勤技术	111	8,630.25	0.01
140	301195	北路智控	210	8,521.80	0.01
141	301202	朗威股份	267	8,490.60	0.01
142	301251	威尔高	244	8,439.96	0.01
143	002567	唐人神	1,100	8,250.00	0.01
144	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.01
145	301326	捷邦科技	200	8,022.00	0.01
146	301528	多浦乐	115	7,924.65	0.01
147	301469	恒达新材	236	7,809.24	0.01
148	301227	森鹰窗业	284	7,687.88	0.01
149	301517	陕西华达	175	7,645.75	0.01
150	301171	易点天下	384	7,591.68	0.00
151	301163	宏德股份	277	7,506.70	0.00
152	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
153	301248	杰创智能	417	7,343.37	0.00
154	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
155	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
156	000858	五粮液	51	7,155.81	0.00

157	301100	风光股份	337	6,834.36	0.00
158	688693	锆威特	154	6,685.14	0.00
159	301418	协昌科技	132	6,626.40	0.00
160	688314	康拓医疗	194	6,384.54	0.00
161	301529	福赛科技	163	6,174.44	0.00
162	301525	儒竞科技	75	6,109.50	0.00
163	001380	华纬科技	170	5,922.80	0.00
164	301500	飞南资源	283	5,911.87	0.00
165	301520	万邦医药	109	5,748.66	0.00
166	688657	浩辰软件	69	5,402.06	0.00
167	002821	凯莱英	44	5,108.40	0.00
168	301276	嘉曼服饰	201	4,900.38	0.00
169	001378	德冠新材	132	4,127.64	0.00
170	603270	金帝股份	139	4,111.62	0.00
171	001282	三联锻造	105	3,797.85	0.00
172	600690	海尔智家	174	3,654.00	0.00
173	603275	众辰科技	81	3,215.70	0.00
174	688356	键凯科技	25	2,660.00	0.00
175	688329	艾隆科技	87	2,162.82	0.00
176	688613	奥精医疗	64	1,424.64	0.00
177	600702	舍得酒业	10	967.00	0.00
178	600258	首旅酒店	50	781.00	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	000999	华润三九	131,754,887.42	36.58
2	600211	西藏药业	107,923,148.48	29.97
3	600298	安琪酵母	98,032,873.63	27.22
4	002304	洋河股份	79,873,910.00	22.18
5	603919	金徽酒	75,720,752.94	21.02
6	000596	古井贡酒	75,591,147.54	20.99
7	002299	圣农发展	74,780,355.99	20.76
8	603589	口子窖	69,437,274.37	19.28
9	603369	今世缘	65,438,119.00	18.17
10	603198	迎驾贡酒	58,962,703.06	16.37
11	002714	牧原股份	57,069,422.61	15.85
12	600702	舍得酒业	51,602,629.10	14.33
13	300119	瑞普生物	51,291,034.44	14.24
14	300871	回盛生物	50,223,946.54	13.94

15	601888	中国中免	47,490,571.98	13.19
16	603609	禾丰股份	42,421,243.20	11.78
17	600559	老白干酒	42,052,134.00	11.68
18	300144	宋城演艺	41,860,605.50	11.62
19	600809	山西汾酒	41,066,681.43	11.40
20	000568	泸州老窖	39,725,685.97	11.03
21	300673	佩蒂股份	37,882,047.85	10.52
22	002567	唐人神	37,773,387.02	10.49
23	000858	五粮液	34,075,527.00	9.46
24	002100	天康生物	32,178,707.25	8.93
25	600690	海尔智家	29,176,167.51	8.10
26	002159	三特索道	28,932,430.00	8.03
27	600887	伊利股份	24,451,715.79	6.79
28	000848	承德露露	24,371,423.20	6.77
29	600993	马应龙	19,254,735.91	5.35
30	300482	万孚生物	17,974,890.05	4.99
31	000333	美的集团	17,901,197.00	4.97
32	601088	中国神华	17,673,212.55	4.91
33	002507	涪陵榨菜	14,369,050.45	3.99
34	300957	贝泰妮	12,925,030.89	3.59
35	688314	康拓医疗	12,371,003.62	3.43
36	600519	贵州茅台	11,898,211.98	3.30
37	002458	益生股份	11,178,588.00	3.10
38	600884	杉杉股份	10,925,829.68	3.03
39	300896	爱美客	10,057,328.78	2.79
40	605081	太和水	9,551,873.05	2.65
41	000799	酒鬼酒	9,290,830.00	2.58
42	600779	水井坊	8,261,817.00	2.29

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	000999	华润三九	132,722,905.99	36.85
2	600211	西藏药业	93,836,282.74	26.05
3	002304	洋河股份	90,898,946.02	25.24
4	600298	安琪酵母	89,311,445.80	24.80
5	002714	牧原股份	78,628,499.78	21.83
6	000596	古井贡酒	74,903,520.00	20.80
7	603198	迎驾贡酒	73,863,737.77	20.51
8	603919	金徽酒	71,845,342.64	19.95
9	002299	圣农发展	69,355,890.73	19.26

10	600702	舍得酒业	67,982,513.00	18.88
11	000568	泸州老窖	66,335,909.45	18.42
12	000858	五粮液	62,353,282.15	17.31
13	600809	山西汾酒	57,943,031.44	16.09
14	603369	今世缘	56,913,185.98	15.80
15	603589	口子窖	55,227,938.05	15.33
16	601888	中国中免	54,820,055.40	15.22
17	300871	回盛生物	51,980,152.95	14.43
18	002567	唐人神	46,274,421.10	12.85
19	300119	瑞普生物	41,849,212.62	11.62
20	603609	禾丰股份	41,032,929.00	11.39
21	300144	宋城演艺	39,681,971.63	11.02
22	300673	佩蒂股份	35,211,193.00	9.78
23	002100	天康生物	32,493,711.00	9.02
24	600559	老白干酒	32,182,475.16	8.94
25	002159	三特索道	29,420,473.00	8.17
26	600690	海尔智家	29,309,227.07	8.14
27	600519	贵州茅台	29,052,489.00	8.07
28	300957	贝泰妮	26,605,212.86	7.39
29	600887	伊利股份	23,677,244.46	6.57
30	000848	承德露露	20,794,641.02	5.77
31	600993	马应龙	19,305,025.81	5.36
32	300482	万孚生物	18,369,309.82	5.10
33	300896	爱美客	18,075,589.40	5.02
34	000333	美的集团	18,063,392.00	5.02
35	601088	中国神华	17,793,846.00	4.94
36	688314	康拓医疗	15,358,287.24	4.26
37	002507	涪陵榨菜	14,387,129.00	3.99
38	000661	长春高新	12,194,894.00	3.39
39	600884	杉杉股份	11,108,269.00	3.08
40	002458	益生股份	11,085,589.00	3.08
41	688161	威高骨科	10,936,926.00	3.04
42	002821	凯莱英	10,078,620.90	2.80
43	000799	酒鬼酒	8,429,712.55	2.34
44	601390	中国中铁	8,300,027.00	2.30
45	603392	万泰生物	8,173,510.23	2.27
46	605081	太和水	8,137,478.50	2.26
47	600779	水井坊	8,053,792.00	2.24

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	1,864,125,202.77
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	2,012,860,678.89
--------------	------------------

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 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，福建圣农发展股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到昌邑市综合行政执法局处罚的情况。

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	151,358.37
2	应收清算款	4,160,164.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,404.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,466,927.06

### 8.12.4 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债券。

### 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)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信消	7,602	2,141.76	157,324.34	0.97%	16,124,345.	99.03%

费主题股票 A					90	
创金合信消费主题股票 C	35,927	1,683.74	7,254,830.23	11.99%	53,236,998.65	88.01%
合计	42,751	1,795.83	7,412,154.57	9.65%	69,361,344.55	90.35%

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	创金合信消费主题股票 A	547,525.51	3.36%
	创金合信消费主题股票 C	26,445.36	0.04%
	合计	573,970.87	0.75%

## 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	创金合信消费主题股票 A	0~10
	创金合信消费主题股票 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信消费主题股票 A	10~50
	创金合信消费主题股票 C	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信消费主题股票 A	创金合信消费主题股票 C
基金合同生效日(2018 年 10 月 11 日)基金份额总额	39,034.53	208,441.93
本报告期期初基金份额总额	38,448,742.91	112,087,138.59
本报告期基金总申购份额	6,931,186.65	41,250,541.19
减：报告期基金总赎回份额	29,098,259.32	92,845,850.90
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	16,281,670.24	60,491,828.88

## § 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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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，本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 6 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	
英大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	951,135,294.96	24.62%	703,734.66	25.17%	-
德邦证券	2	1,831,866,975.66	47.43%	1,331,869.64	47.64%	-
光大证券	2	84,272,822.71	2.18%	78,025.26	2.79%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	181,261,844.73	4.69%	133,252.80	4.77%	-
民生证券	2	362,726,114.01	9.39%	265,508.84	9.50%	-
招商证券	2	150,380,646.15	3.89%	64,217.96	2.30%	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	退租
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	301,001,137.29	7.79%	218,829.56	7.83%	-
第一创业证券	4	-	-	-	-	-

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，并能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。

本基金报告期内退租中投证券 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				比例		
英大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
第一创业 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	创金合信消费主题股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
3	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购（含定期定额投资）及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
4	创金合信消费主题股票型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	创金合信消费主题股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
6	创金合信消费主题股票型证券投资基金（2023 年 7 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
7	创金合信消费主题股票型证券投资基金(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	2023-07-11
8	创金合信消费主题股票型证券投资基金(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	2023-07-11
9	创金合信基金管理有限公司关于修改旗下部分基金基金合同等法律文件的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子	2023-07-19

		披露网站	
10	创金合信消费主题股票型证券投资基金（2023年7月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-19
11	创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同（2023年7月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-19
12	创金合信消费主题股票型证券投资基金托管协议（2023年7月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-19
13	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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
14	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同份额类别相互转换业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-22
15	创金合信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
16	创金合信消费主题股票型证券投资基金（2023年8月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
17	创金合信消费主题股票型证券投资基金(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	2023-08-30
18	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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
19	创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同（2023年8月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-30
20	创金合信消费主题股票型证券投资基金(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	2023-08-30
21	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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-02
22	创金合信消费主题股票型证券投资基金 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

## § 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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机构	1	20230101 - 20230108, 20230116 - 20230409, 20230516 - 20231009	30,889,652.88	0.00	30,889,652.88	0.00	0.00%

**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。

**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、《创金合信消费主题股票型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信消费主题股票型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信消费主题股票型证券投资基金 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.cjxfund.com](http://www.cjxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日