

创金合信优选回报灵活配置混合型证 券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
4.8 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.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	32
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 报告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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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债券投资明细.....	38
7.7 报告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.....	38

7.8	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	38
7.9	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权证投资明细	38
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
§8	基金份额持有人信息	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3	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情况	40
§9	开放式基金份额变动	40
§10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
10.2	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	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4	基金投资策略的改变	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	44
§11	影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1	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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	45
§12	备查文件目录	45
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	45
12.3	查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	创金合信优选回报混合
基金主代码	005076
交易代码	005076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 27 日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,890,720.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，追求基金资产净值的长期稳健增长。
投资策略	在大类资产配置上，本基金将通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策分析和预测，判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势，结合对资金供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析，评估各类别资产的风险收益特征，并加以分析比较，采用定性和定量相结合的方法，形成对不同类别资产表现的预测，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等资产类别间的配置比例。 本基金将密切关注市场整体风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，在严格控制基金风险敞口的前提下，根据敞口大小和资产风险水平动态调整各大类资产之间的配置比例，力争提高基金收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*30%+中债综合指数收益率*70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，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	中国工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.com
客户服务电话	400-868-0666	95588
传真	0755-25832571	(010) 66105798

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）	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518052	100140
法定代表人	钱龙海	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-19,265,079.19
本期利润	-20,726,670.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0930
本期加权平均净值利润率	-14.24%
本期基金份额净值增长率	-13.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-117,059,530.39
期末可供分配基金份额利润	-0.5551
期末基金资产净值	127,034,159.18
期末基金份额净值	0.6024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.65%

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。

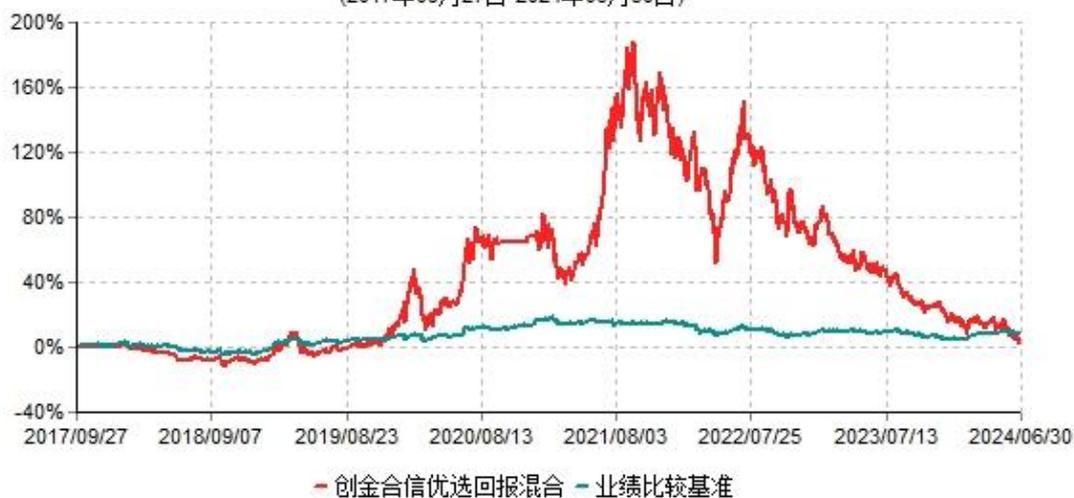
3.2 基金净值表现

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

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
过去一个月	-4.08%	1.32%	-0.55%	0.14%	-3.53%	1.18%
过去三个月	-7.89%	1.59%	0.12%	0.21%	-8.01%	1.38%
过去六个月	-13.31%	1.35%	2.07%	0.26%	-15.38%	1.09%
过去一年	-28.57%	1.20%	-0.67%	0.26%	-27.90%	0.94%
过去三年	-45.67%	2.01%	-6.79%	0.31%	-38.88%	1.70%
自基金合同生效起至今	4.65%	1.70%	8.18%	0.35%	-3.53%	1.35%

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

创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年09月27日-2024年06月30日)



§ 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 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，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		
曹春林	本基金基金经理	2019 年 9 月 25 日	-	19	曹春林先生，中国国籍，厦门大学学士。1998 年 7 月加入中国银河证券股份有限公司，任研发部研究员，2004 年 3 月加入茂业国际控股有限公司，任策略投资部投资岗，2010 年 4 月加入第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监、投资经理，现任基金经理、兼任投资经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
曹春林	公募基金	3	2,542,824,405.27	2018-05-08

	私募资产管理计划	2	10,269,919.31	2024-03-13
	其他组合	-	-	-
	合计	5	2,553,094,324.58	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十二条规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人会在十个交易日内进行调整。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2024 年开年市场延续去年的弱势出现了较大幅度的波动，后在政策的呵护下有所恢复，但整体来说还是延续偏弱态势。个股分化程度很大，在利率下行期一些经营表现较稳健的如公用事业、价格预期较稳定的资源股表现较好；大盘龙头股的走势强于市场，在行业下行期龙头股表现出更优秀抗周期能力。

在经历了外胀内缩后中国的产品竞争力进一步加强，出口明显强于内需，中国的制造业的增长成功弥补了地产行业的产出下降，从数据上看中国的经济远没有市场预期般的差。但是由于房地产价格下降、居民财富缩水，经济也呈现明显的结构性差异，与大多数居民就业收入相关的产业表现不太好。在地产的下行周期里，整体宏观经济是会有一定压力的，这需要时间去化解。

上半年本产品主要配置供需关系较好的上游资源、经营稳健的电力、新能源汽车的龙头个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信优选回报混合基金份额净值为 0.6024 元，本报告期内，份额净值增长率为-13.31%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为中长期来看中国谨慎的宏观政策有助于经济的风险释放和结构转型升级，中国的产业转型升级和全球化的逻辑正在实现，由此将诞生出众多成长性良好的优质股票，所以也没有理由看空中国经济的长远前景。但是我们也应该看到上一轮的高景气诱导了中国制造业产能的大幅扩张，叠加了资产价格调整导致的内需不振，制造业正在经历产能利用率不足、增收不增利的困境，大部分企业都面临着激烈的竞争和产品价格下行压力，在投资中需要平衡和管理好短期风险和尾部风险。密切关注政策，经济数据如果下滑过快，逆周期政策出台的概率和力度会更大。

未来组合策略上，除了关注贵金属和供需格局好的工业金属外，需重视产业转型升级和全球化这个逻辑，如新能源汽车、医药、半导体、光伏等成长性行业，在其行业调整周期里展现出明显阿尔法的龙头企业将是极具投资价值的。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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,不存在任何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,本基金的管理人—创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,460,363.70	10,244,817.75
结算备付金		830,589.17	545,412.59
存出保证金		162,908.51	169,655.30

交易性金融资产	6.4.7.2	113,687,165.84	124,189,645.15
其中：股票投资		113,687,165.84	124,189,645.15
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		6,755,197.42	32,796,540.73
应收股利		-	-
应收申购款		20,233.14	19,103.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		130,916,457.78	167,965,174.62
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,189,709.61	-
应付赎回款		67,356.74	153,552.93
应付管理人报酬		128,082.22	175,206.93
应付托管费		21,347.01	29,201.16
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	475,803.02	626,903.94
负债合计		3,882,298.60	984,864.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	210,890,720.16	240,301,474.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-83,856,560.98	-73,321,164.62

净资产合计		127,034,159.18	166,980,309.66
负债和净资产总计		130,916,457.78	167,965,174.62

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6024 元，基金份额总额 210,890,720.16 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-19,608,617.01	-24,999,597.97
1.利息收入		57,782.70	44,517.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,782.70	44,517.11
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）		-18,219,305.92	-52,066,599.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,821,628.14	-54,526,630.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	106.29	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,602,215.93	2,460,031.16
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）	6.4.7.16	-1,461,591.39	26,924,855.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,497.60	97,628.37

减：二、营业总支出		1,118,053.57	2,322,543.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	869,640.24	1,902,295.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	144,939.97	317,049.30
3.销售服务费		-	-
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	103,473.36	103,198.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,726,670.58	-27,322,141.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,726,670.58	-27,322,141.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,726,670.58	-27,322,141.53

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	240,301,474.28	-	-73,321,164.62	166,980,309.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	240,301,474.28	-	-73,321,164.62	166,980,309.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,410,754.12	-	-10,535,396.36	-39,946,150.48
（一）、综合收益总额	-	-	-20,726,670.58	-20,726,670.58
（二）、本期基	-29,410,754.12	-	10,191,274.22	-19,219,479.90

基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	8,831,954.31	-	-3,062,629.93	5,769,324.38
2.基金赎回款	-38,242,708.43	-	13,253,904.15	-24,988,804.28
（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	210,890,720.16	-	-83,856,560.98	127,034,159.18
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	272,623,492.89	-	-16,104,391.06	256,519,101.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	272,623,492.89	-	-16,104,391.06	256,519,101.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,597,841.67	-	-27,023,282.68	-24,425,441.01
（一）、综合收益总额	-	-	-27,322,141.53	-27,322,141.53
（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）	2,597,841.67	-	298,858.85	2,896,700.52
其中：1.基金申购款	55,072,815.79	-	-4,006,381.68	51,066,434.11
2.基金赎回款	-52,474,974.12	-	4,305,240.53	-48,169,733.59

(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	275,221,334.56	-	-43,127,673.74	232,093,660.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信优选回报灵活配置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”)证监许可[2017]第 1258 号《关于准予创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,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》和《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 822,731,554.84 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 324 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 822,948,446.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 216,891.71 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信优选回报灵活配置混合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(包括创业板、中小板、存托凭证以及其他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、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、货币市场工具(包括同业存单等)、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%。每个交易日日终,在扣

除股指期货、股票期权、国债期货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：沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%。

6.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.6 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	9,460,363.70
等于：本金	9,459,345.45
加：应计利息	1,018.25
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	9,460,363.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	124,596,767.58	-	113,687,165.84	-10,909,601.74
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	124,596,767.58	-	113,687,165.84	-10,909,601.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	381,955.66
其中：交易所市场	381,955.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,835.36
合计	475,803.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	240,301,474.28	240,301,474.28
本期申购	8,831,954.31	8,831,954.31
本期赎回（以“-”号填列）	-38,242,708.43	-38,242,708.43
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	210,890,720.16	210,890,720.16

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-113,178,514.25	39,857,349.63	-73,321,164.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-113,178,514.25	39,857,349.63	-73,321,164.62
本期利润	-19,265,079.19	-1,461,591.39	-20,726,670.58
本期基金份额交易产生的变动数	15,384,063.05	-5,192,788.83	10,191,274.22
其中：基金申购款	-4,620,942.99	1,558,313.06	-3,062,629.93
基金赎回款	20,005,006.04	-6,751,101.89	13,253,904.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-117,059,530.39	33,202,969.41	-83,856,560.98

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	49,690.01
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	6,758.49
其他	1,334.20
合计	57,782.70

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,821,628.14
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	-19,821,628.14

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	573,068,370.95
减：卖出股票成本总额	591,713,146.72
减：交易费用	1,176,852.37
买卖股票差价收入	-19,821,628.14

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	155.29

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-49.00
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	106.29

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	102,180.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,049.00
减：应计利息总额	2,180.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-49.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,602,215.93
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	1,602,215.93

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,461,591.39
——股票投资	-1,461,591.39
——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	-1,461,591.39

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,470.28
转换费收入	27.32
合计	14,497.60

6.4.7.18 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。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	338.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	103,473.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	869,640.24	1,902,295.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	390,502.51	854,258.58
应支付基金管理人的净管理费	479,137.73	1,048,037.12

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 1.2% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	144,939.97	317,049.30

注：支付基金托管人中国工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：

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	9,460,363.70	49,690.01	25,824,221.16	36,626.85

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

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	1-6 个月（含）	新股锁定	19.18	22.66	83	1,591.94	1,880.78	-

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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中国工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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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 2024 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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货币资金、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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,460,363.70	-	-	-	9,460,363.70
结算备付金	830,589.17	-	-	-	830,589.17
存出保证金	162,908.51	-	-	-	162,908.51
交易性金融资产	-	-	-	113,687,165.84	113,687,165.84
应收申购款	-	-	-	20,233.14	20,233.14
应收清算款	-	-	-	6,755,197.42	6,755,197.42
资产总计	10,453,861.38	-	-	120,462,596.40	130,916,457.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,356.74	67,356.74
应付管理人报酬	-	-	-	128,082.22	128,082.22
应付托管费	-	-	-	21,347.01	21,347.01
应付清算款	-	-	-	3,189,709.61	3,189,709.61
其他负债	-	-	-	475,803.02	475,803.02
负债总计	-	-	-	3,882,298.60	3,882,298.60
利率敏感度缺口	10,453,861.38	-	-	116,580,297.80	127,034,159.18
上年度末 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	10,244,817.75	-	-	-	10,244,817.75
结算备付金	545,412.59	-	-	-	545,412.59
存出保证金	169,655.30	-	-	-	169,655.30
交易性金融资产	-	-	-	124,189,645.15	124,189,645.15

应收申购款	-	-	-	19,103.10	19,103.10
应收清算款	-	-	-	32,796,540.73	32,796,540.73
资产总计	10,959,885.64	-	-	157,005,288.98	167,965,174.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	153,552.93	153,552.93
应付管理人报酬	-	-	-	175,206.93	175,206.93
应付托管费	-	-	-	29,201.16	29,201.16
其他负债	-	-	-	626,903.94	626,903.94
负债总计	-	-	-	984,864.96	984,864.96
利率敏感度缺口	10,959,885.64	-	-	156,020,424.02	166,980,309.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	113,687,165.84	89.49	124,189,645.15	74.37
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	113,687,165.84	89.49	124,189,645.15	74.37

6.4.13.4.3.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	17,881,285.88	20,488,186.71
	2.业绩比较基准下降 5%	-17,881,285.88	-20,488,186.71

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	113,679,746.66
第二层次	-
第三层次	7,419.18
合计	113,687,165.84

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 6 月 30 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	113,687,165.84	86.84
	其中：股票	113,687,165.84	86.84
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,290,952.87	7.86
7	其他资产	6,938,339.07	5.30
8	合计	130,916,457.78	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,168,110.00	1.71
B	采矿业	66,834,922.80	52.61
C	制造业	37,735,411.04	29.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,197,472.00	2.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,751,250.00	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	113,687,165.84	89.49

7.2.2 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。

7.3 报告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	603993	洛阳钼业	1,508,600	12,823,100.00	10.09
2	601899	紫金矿业	702,500	12,342,925.00	9.72
3	600362	江西铜业	481,201	11,394,839.68	8.97
4	601168	西部矿业	608,000	10,913,600.00	8.59
5	600547	山东黄金	349,200	9,561,096.00	7.53

6	000625	长安汽车	600,491	8,064,594.13	6.35
7	000878	云南铜业	566,000	7,052,360.00	5.55
8	000426	兴业银锡	449,400	6,102,852.00	4.80
9	600489	中金黄金	345,471	5,112,970.80	4.02
10	603979	金诚信	87,600	4,426,428.00	3.48
11	601028	玉龙股份	300,100	3,751,250.00	2.95
12	000630	铜陵有色	940,600	3,395,566.00	2.67
13	600886	国投电力	175,300	3,197,472.00	2.52
14	601225	陕西煤业	120,300	3,100,131.00	2.44
15	002371	北方华创	9,600	3,070,944.00	2.42
16	002128	电投能源	116,200	2,451,820.00	1.93
17	300750	宁德时代	12,901	2,322,567.03	1.83
18	002299	圣农发展	90,200	1,230,328.00	0.97
19	600961	株冶集团	114,600	1,081,824.00	0.85
20	000998	隆平高科	95,400	937,782.00	0.74
21	000657	中钨高新	82,700	755,878.00	0.60
22	000408	藏格矿业	24,200	582,494.00	0.46
23	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
24	000768	中航西飞	200	4,806.00	0.00
25	603344	星德胜	83	1,880.78	0.00
26	688599	天合光能	86	1,455.12	0.00
27	603799	华友钴业	30	663.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600941	中国移动	21,457,523.00	12.85
2	000625	长安汽车	19,120,426.90	11.45
3	601699	潞安环能	18,404,936.00	11.02
4	600188	兖矿能源	15,480,031.49	9.27
5	603993	洛阳钼业	13,264,670.00	7.94
6	600050	中国联通	12,764,971.50	7.64
7	601899	紫金矿业	12,733,626.00	7.63
8	000878	云南铜业	12,654,796.00	7.58
9	600362	江西铜业	12,438,620.34	7.45
10	601168	西部矿业	12,364,379.00	7.40
11	600348	华阳股份	11,930,317.00	7.14
12	601985	中国核电	11,557,700.17	6.92
13	601028	玉龙股份	11,024,516.00	6.60
14	600886	国投电力	10,778,209.00	6.45

15	600256	广汇能源	10,752,201.00	6.44
16	600547	山东黄金	10,593,412.60	6.34
17	000933	神火股份	10,140,982.00	6.07
18	600025	华能水电	9,998,629.00	5.99
19	601728	中国电信	9,171,839.00	5.49
20	002738	中矿资源	9,157,963.84	5.48
21	000923	河钢资源	8,883,844.94	5.32
22	000630	铜陵有色	8,776,549.00	5.26
23	600489	中金黄金	8,480,178.62	5.08
24	002532	天山铝业	8,281,812.00	4.96
25	601088	中国神华	8,167,803.25	4.89
26	000426	兴业银锡	7,871,869.00	4.71
27	002594	比亚迪	7,777,334.00	4.66
28	601881	中国银河	7,494,336.00	4.49
29	601816	京沪高铁	7,420,593.00	4.44
30	600988	赤峰黄金	7,152,477.00	4.28
31	603501	韦尔股份	7,036,709.40	4.21
32	600030	中信证券	6,744,000.00	4.04
33	600900	长江电力	6,680,515.00	4.00
34	002460	赣锋锂业	6,174,778.00	3.70
35	002466	天齐锂业	6,147,642.00	3.68
36	601225	陕西煤业	5,883,033.00	3.52
37	601390	中国中铁	5,765,394.00	3.45
38	002155	湖南黄金	5,742,555.00	3.44
39	600418	江淮汽车	5,651,937.00	3.38
40	600961	株冶集团	5,532,034.00	3.31
41	601666	平煤股份	5,234,653.00	3.13
42	000408	藏格矿业	5,034,690.00	3.02
43	600763	通策医疗	4,975,563.00	2.98
44	000001	平安银行	4,596,063.00	2.75
45	603979	金诚信	4,471,541.00	2.68
46	600985	淮北矿业	4,446,682.00	2.66
47	300723	一品红	4,388,963.00	2.63
48	002965	祥鑫科技	4,380,158.00	2.62
49	600546	山煤国际	4,290,062.00	2.57
50	601101	昊华能源	4,283,822.40	2.57
51	300274	阳光电源	4,170,477.00	2.50
52	002472	双环传动	4,169,434.00	2.50
53	601001	晋控煤业	4,104,652.00	2.46
54	002276	万马股份	4,083,595.00	2.45
55	000807	云铝股份	4,010,113.00	2.40
56	600674	川投能源	3,925,853.00	2.35
57	601006	大秦铁路	3,857,083.00	2.31

58	000963	华东医药	3,811,522.00	2.28
59	601898	中煤能源	3,655,837.00	2.19
60	003816	中国广核	3,643,590.00	2.18
61	600508	上海能源	3,641,833.00	2.18
62	000960	锡业股份	3,618,549.71	2.17
63	300308	中际旭创	3,586,078.00	2.15
64	002601	龙佰集团	3,557,810.00	2.13
65	000977	浪潮信息	3,452,383.00	2.07
66	002299	圣农发展	3,445,769.00	2.06
67	600885	宏发股份	3,423,534.00	2.05

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。

7.4.2 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	600941	中国移动	22,008,098.46	13.18
2	000625	长安汽车	20,304,330.03	12.16
3	002466	天齐锂业	19,947,062.31	11.95
4	601699	潞安环能	18,125,435.60	10.85
5	002460	赣锋锂业	16,054,036.10	9.61
6	002738	中矿资源	15,197,899.88	9.10
7	600188	兖矿能源	14,977,988.52	8.97
8	000792	盐湖股份	13,728,726.00	8.22
9	601985	中国核电	13,113,318.94	7.85
10	600050	中国联通	12,955,247.00	7.76
11	600348	华阳股份	11,951,204.58	7.16
12	000998	隆平高科	11,693,418.00	7.00
13	600025	华能水电	10,982,301.00	6.58
14	002594	比亚迪	10,585,752.12	6.34
15	300750	宁德时代	10,582,688.00	6.34
16	600256	广汇能源	10,001,357.00	5.99
17	000933	神火股份	9,786,682.00	5.86
18	000762	西藏矿业	8,926,928.74	5.35
19	601728	中国电信	8,912,057.00	5.34
20	002532	天山铝业	8,820,263.00	5.28
21	000923	河钢资源	8,768,527.00	5.25
22	603501	韦尔股份	8,564,373.80	5.13
23	601088	中国神华	8,502,610.25	5.09
24	600886	国投电力	7,950,518.00	4.76
25	600745	闻泰科技	7,933,052.00	4.75
26	600763	通策医疗	7,916,397.60	4.74

27	601881	中国银河	7,619,594.97	4.56
28	601816	京沪高铁	7,311,954.00	4.38
29	601028	玉龙股份	7,205,990.00	4.32
30	600030	中信证券	6,828,083.00	4.09
31	002155	湖南黄金	6,762,250.00	4.05
32	600988	赤峰黄金	6,717,861.00	4.02
33	600900	长江电力	6,697,975.00	4.01
34	002192	融捷股份	6,555,121.00	3.93
35	601390	中国中铁	5,943,543.00	3.56
36	601666	平煤股份	5,599,264.50	3.35
37	600418	江淮汽车	5,392,765.00	3.23
38	000630	铜陵有色	4,595,942.00	2.75
39	000001	平安银行	4,523,965.00	2.71
40	600985	淮北矿业	4,459,654.00	2.67
41	603993	洛阳钼业	4,412,303.00	2.64
42	300723	一品红	4,317,851.00	2.59
43	002965	祥鑫科技	4,316,069.37	2.58
44	600674	川投能源	4,284,721.00	2.57
45	002472	双环传动	4,218,006.00	2.53
46	000408	藏格矿业	4,173,600.00	2.50
47	002276	万马股份	4,167,757.00	2.50
48	600961	株冶集团	4,161,406.00	2.49
49	300274	阳光电源	4,119,174.00	2.47
50	601101	昊华能源	4,094,552.40	2.45
51	601001	晋控煤业	3,880,435.00	2.32
52	000963	华东医药	3,871,519.00	2.32
53	000807	云铝股份	3,860,788.00	2.31
54	000878	云南铜业	3,826,441.00	2.29
55	601006	大秦铁路	3,824,546.00	2.29
56	600508	上海能源	3,729,801.00	2.23
57	000960	锡业股份	3,655,087.00	2.19
58	300308	中际旭创	3,641,346.00	2.18
59	003816	中国广核	3,605,456.00	2.16
60	002601	龙佰集团	3,579,052.00	2.14
61	000977	浪潮信息	3,482,695.00	2.09
62	600546	山煤国际	3,468,182.00	2.08
63	000598	兴蓉环境	3,463,000.00	2.07
64	601898	中煤能源	3,435,952.27	2.06
65	600885	宏发股份	3,412,782.00	2.04

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。

7.4.3 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	582,672,258.80
卖出股票收入（成交）总额	573,068,370.95

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。

7.5 报告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。

7.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告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。

7.8 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。

7.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，江西铜业股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到上海铁路监督管理局处罚的情况。

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。

7.12.2

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。

7.12.3 报告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	162,908.51
2	应收清算款	6,755,197.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,233.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,938,339.07

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	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	持有份额	占总份

(户)			额比例		额比例
14,038	15,022.85	-	-	210,890,720.16	100.00%

8.2 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	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	807,506.61	0.38%

8.3 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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年9月27日)基金份额总额	822,948,446.55
本报告期期初基金份额总额	240,301,474.28
本报告期基金总申购份额	8,831,954.31
减：报告期基金总赎回份额	38,242,708.43
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	210,890,720.16

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2024年7月1日起，宋明华先生担任公司监事会主席；

2024年7月1日起，郑晓敏女士担任公司职工监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	55,749,452.22	4.82%	41,231.02	5.05%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	881,001.00	0.08%	656.92	0.08%	-
华创证券	2	113,017,967.34	9.78%	83,607.62	10.24%	-
华福证券	2	230,312,908.24	19.93%	170,857.44	20.93%	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	13,837.60	0.00%	10.17	0.00%	-
联储证券	2	109,751,039.68	9.50%	81,476.16	9.98%	-
民生证券	2	221,083,673.47	19.13%	164,164.04	20.11%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	95,019,807.32	8.22%	32,477.08	3.98%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	37,974,689.42	3.29%	28,327.36	3.47%	-
兴业证券	2	27,156,026.90	2.35%	20,109.35	2.46%	-
银河证券	2	1,416,728.00	0.12%	1,056.12	0.13%	-
招商证券	2	36,663,794.07	3.17%	27,166.98	3.33%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	216,598,355.61	18.74%	160,604.37	19.68%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-
第一创业 证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	4	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	10,052,511.00	0.87%	4,465.22	0.55%	-

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东方证券 2 个交易单元、浙商证券 2 个交易单元、民生证券 2 个交易单元、中邮证券 2 个交易单元、西南证券 2 个交易单元。

10.7.2 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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	100,049.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下所有基金产品在直销柜台实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-30

3	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-28
4	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
5	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金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	2024-06-27
6	创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金（2024 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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，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 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心，倡导合伙文化，致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1615.63 亿元。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告原文。

12.2 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

12.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日