
创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金
(原创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型)

2020 年中期报告

2020 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月20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。

自2020年06月09日起，创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金正式变更为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金，原创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金报告期自2020年04月01日起至2020年06月08日止，创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金报告期自2020年06月09日起至2020年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现(转型后) | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现（转型前） | 10 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 10 |
| 3.2 基金净值表现 | 11 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 16 |
| 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 | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 16 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)(转型后) | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 18 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)(转型前) | 44 |
| 6.1 资产负债表 | 44 |
| 6.2 利润表 | 45 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 47 |
| 6.4 报表附注 | 48 |
| §7 投资组合报告(转型后) | 67 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 67 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 68 |
| 7.3 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 | 68 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 68 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 68 |
| 7.6 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 | 69 |
| 7.7 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 | 69 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 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 | 69 |
| 7.9 | 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 | 69 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 69 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 69 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 69 |
| §7 | 投资组合报告（转型前） | 70 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 70 |
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 71 |
| 7.3 | 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 | 71 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 71 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 71 |
| 7.6 | 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 | 72 |
| 7.7 | 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 | 72 |
| 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 | 72 |
| 7.9 | 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 | 72 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 72 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 72 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 73 |
| §8 | 基金份额持有人信息(转型后) | 73 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 73 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 74 |
| 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 | 74 |
| §8 | 基金份额持有人信息(转型前) | 75 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 75 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 75 |
| 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 | 75 |
| §9 | 开放式基金份额变动(转型后) | 75 |
| §9 | 开放式基金份额变动(转型前) | 76 |
| §10 | 重大事件揭示 | 76 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 76 |
| 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 | 76 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 76 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 77 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 77 |
| 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 | 77 |
| | 转型后 | 77 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 77 |
| | 转型前 | 78 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 78 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 80 |
| §11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 81 |
| 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 | 81 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 82 |
| §12 | 备查文件目录 | 82 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 82 |
| 12.2 | 存放地点 | 82 |
| 12.3 | 查阅方式 | 82 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

| | | |
|-----------------|------------------------|-------------|
| 基金名称 | 创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 创金合信季安鑫3个月 | |
| 基金主代码 | 002337 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金转型合同生效日 | 2020年06月09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 | 544,770.27份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信季安鑫3个月A | 创金合信季安鑫3个月C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002337 | 009459 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 543,522.07份 | 1,248.20份 |

转型前

| | | |
|------------|-------------------|--|
| 基金名称 | 创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 创金合信尊盈纯债债券 | |
| 基金主代码 | 002337 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年01月07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 | 634,212.93份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |

2.2 基金产品说明

转型后

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，本基金将投资组合的平均久期控制在2年以内，力争实现基金资产的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

转型前

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，力争实现基金资产的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合（全价）指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | 梁绍锋 |
| | 联系电话 | 0755-23838908 |
| | 电子邮箱 | liangshaofeng@cjhxfund.com |
| 客户服务电话 | 400-868-0666 | 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 | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | 518000 | 518040 |
| 法定代表人 | 刘学民 | 李建红 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金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 | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 |

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 | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现(转型后)

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(2020年06月09日-2020年06月30日) | |
|---------------|------------------------------|-------------|
| | 创金合信季安鑫3个月A | 创金合信季安鑫3个月C |
| 本期已实现收益 | 938.54 | 0.99 |
| 本期利润 | -1,437.29 | 0.82 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0026 | 0.0013 |

| | | |
|----------------------|-------------------|----------|
| 本期加权平均净值利润率 | -0.26% | 0.13% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.23% | 0.21% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -89,486.48 | 2.62 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1646 | 0.0021 |
| 期末基金资产净值 | 544,749.75 | 1,250.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.0023 | 1.0021 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.23% | 0.21% |

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 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。

4. 本基金合同生效日为2020年6月9日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

创金合信季安鑫3个月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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.23% | 0.05% | 0.11% | 0.05% | 0.12% | 0.00% |

创金合信季安鑫3个月C

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 增长率① | 增长率标 准差② | 基准收益 率③ | 基准收益 率标准差 ④ | | |
|----------------|-------|-------------|------------|-------------------|-------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | 0.21% | 0.04% | 0.11% | 0.05% | 0.10% | -0.01% |

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





注：1、本基金的基金合同于 2020 年 06 月 09 日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）

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（2020年01月01日- 2020年06月08日） |
|---------------|-------------------------------|
| 本期已实现收益 | 9,633.86 |
| 本期利润 | 2,644.71 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0040 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.46% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2020年06月08日） |
| 期末可供分配利润 | -90,876.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1433 |

| | |
|---------------------|-------------------|
| 期末基金资产净值 | 543,336.90 |
| 期末基金份额净值 | 0.8570 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2020年06月08日） |
| 基金份额累计净值增长率 | -14.30% |

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 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 (2020年06月01日-2020年06月08日) | -0.46% | 0.09% | -0.91% | 0.11% | 0.45% | -0.02% |
| 过去三个月 (2020年04月01日-2020年06月08日) | -0.81% | 0.09% | -1.01% | 0.13% | 0.20% | -0.04% |
| 过去六个月 (2020年01月01日-2020年06月08日) | 0.47% | 0.15% | 0.83% | 0.11% | -0.36% | 0.04% |
| 过去一年(2019年07月01日-2020年06月08日) | -8.05% | 0.18% | 1.91% | 0.08% | -9.96% | 0.10% |

| | | | | | | |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去三年(2017年07月01日-2020年06月08日) | -15.06% | 0.24% | 5.64% | 0.07% | -20.70% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今(2016年01月07日-2020年06月08日) | -14.30% | 0.22% | 1.87% | 0.08% | -16.17% | 0.14% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 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2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创

业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。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。报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2020年6月30日，本公司共管理49只公募基金，其中混合型产品13只、指数型产品5只、债券型产品20只、股票型产品10只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约340.38亿元。

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 | | |
| 王一兵 | 本基金基金经理、固定收益部总监 | 2020-06-09 | - | 16年 | 王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。曾任职于四川和正期货公司，2009年3月加入第一创业证券股份有限公司，历任固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任固定收益部总监、基金经理。 |

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

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金，基金理由郑振源变更为王一兵。

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》、《证券投资基金销售管理办法》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

2020年上半年债券市场呈现先下行后大幅上行的行情。10年国债利率整体上行5bp左右，最低下探至2.5%附近，隔夜回购利率中枢从2%以上下降到1%以内，5月后又重新上行至2%附近。1月底新冠疫情开始爆发，经济停摆，政策为了稳增长持续宽松；2月中下旬，国内疫情总体得控，但3月底海外疫情开始愈演愈烈的，受超预期下调超额存款准备金率和定向降准的影响，债券收益率继续大幅下行。4月中下旬开始，金融、经济数据边际改善，两会召开时间确定，并提出防范资金套利空转问题，预示着经济基本面探底回升势头良好，国内疫情防控取得较好成效，监管层开始重视宽松货币政策带来的“后遗症”，央行货币政策开始进入“观测期”，叠加利率债供给压力，资金价格不断抬升，5月份至6月份，债市进入上行态势。二季度债市的变化核心在于央行撤出应对疫情的危机模式，更加注重保增长和防风险的平衡，货币政策出现边际收紧。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年6月30日，创金合信季安鑫3个月A基金份额净值为1.0023元；自2020年6月9日至2020年6月30日本基金份额净值增长率为0.23%，同期业绩比较基准收益率为0.11%。

截至2020年6月30日，创金合信季安鑫3个月C基金份额净值为1.0021元；自2020年6月9日至2020年6月30日本基金份额净值增长率为0.21%，同期业绩比较基准收益率为0.11%。

截至2020年6月8日，创金合信尊盈纯债基金份额净值为0.857元；自2020年1月1日至2020年6月8日本基金份额净值增长率为0.47%，同期业绩比较基准收益率为0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向前看，经济延续回暖，但恢复速度有所放缓，供需不平衡继续，货币政策的宽松基调未变，稳增长仍是重要目标，政策短期难转向，但也难以回到3-4月份的宽松状态。外部方面，欧洲疫情得控和经济重启，经济表现逐渐恢复，美国疫情因重启及抗议活动，再度爆发，恢复前景暗淡。外需总体偏弱。内部方面，经济持续改善，但很可能已走过最快的复苏阶段，且疫情对餐饮旅游服务等相关领域的压制仍存在，经济仍运行在潜在增速以下。因此，在经济持续恢复和仍面临不确定性环境下，货币政策出现实质转向的可能性较低；短期，基于防范金融风险的要求，货币政策也难以重新回到之前的超宽松时期，后续将进入观察期。债市总体进入震荡期，票息策略优于久期策略。资金成本仍较为便宜，杠杆套息仍可以适当提升投资收益。

本基金将继续结合宏观政策形势变化，适时进行久期调节，注重票息收益，严控信用风险，力争为投资者赚取良好的投资回报。

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

创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金自2020年6月9日起，正式变更为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金。

本基金转型前，已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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。

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

本年度中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)(转型后)

6.1 资产负债表

会计主体: 创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日: 2020年06月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------|---------|--------------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 89,294.11 |
| 结算备付金 | | - |

| | | |
|-----------------|------------|--------------------|
| 存出保证金 | | 107.97 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 451,484.00 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 451,484.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 7,763.07 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 548,649.15 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020年06月30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 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 117.66 |
| 应付托管费 | | 44.68 |
| 应付销售服务费 | | 0.12 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |

| | | |
|---------------|----------|------------|
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 2,486.12 |
| 负债合计 | | 2,648.58 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 635,484.43 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -89,483.86 |
| 所有者权益合计 | | 546,000.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 548,649.15 |

注：1. 报告截止日2020年06月30日，基金份额总额544,770.27份，其中下属A类基金份额543,522.07份，C类基金份额1,248.20份。下属A类基金份额净值1.0023元，C类基金份额净值1.0021元。

2. 本基金由创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型而来，本财务报表的实际报告期间为2020年06月09日（基金合同生效日）至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2020年06月09日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2020年06月09日至2020年06月30日 |
|-------------------|----------|---------------------------|
| 一、收入 | | 1,809.00 |
| 1. 利息收入 | | 1,149.00 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 19.22 |
| 债券利息收入 | | 1,129.78 |
| 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） | | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|----------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.2 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 660.00 |
| 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 | - |
| 减：二、费用 | | 415.33 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 81.93 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 32.76 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 0.12 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | - |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 300.52 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,393.67 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,393.67 |

注：本基金由创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型而来，本财务报表的实际报告期间为2020年06月09日（基金合同生效日）至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2020年06月09日至2020年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|-------------------------|
| | 2020年06月09日至2020年06月30日 |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|------------|------------|------------|
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 634,212.93 | -90,876.03 | 543,336.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,393.67 | 1,393.67 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 1,271.50 | -1.50 | 1,270.00 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 1,271.50 | -1.50 | 1,270.00 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 635,484.43 | -89,483.86 | 546,000.57 |

注：本基金由创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型而来，本财务报表的实际报告期间为2020年06月09日(基金合同生效日)至2020年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

黄越岷

安兆国

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

创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金是由原创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金（以下简称“创金合信尊盈纯债债券”）转型而来。根据原创金合信尊盈纯债债券基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信尊盈纯债债券型证券

投资基金转型有关事项的议案》，创金合信尊盈纯债债券的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2020年5月12日发布了《创金合信尊盈纯债债券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《关于创金合信尊盈纯债债券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2020年6月9日起，原创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金名称变更为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），《创金合信季安鑫3个月持有期债券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《创金合信季安鑫3个月持有期债券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《创金合信季安鑫3个月持有期债券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债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、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（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、永续债、同业存单、国债期货以及货币市场工具等。本基金的业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率 \times 80%+一年期定期存款利率（税后） \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2020年06月09日(基金合同生效日)至2020年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

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

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部
分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(b) 基金收益分配后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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(c) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资

管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|--------------|-------------|
| | 2020年06月30日 |
| 活期存款 | 89,294.11 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 89,294.11 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2020年06月30日 | | | |
|---------------|----------------|------------|------------|-----------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 456,754.00 | 451,484.00 | -5,270.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 456,754.00 | 451,484.00 | -5,270.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 456,754.00 | 451,484.00 | -5,270.00 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 8.70 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 7,754.37 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 7,763.07 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |

| | |
|------|----------|
| 预提费用 | 2,486.12 |
| 合计 | 2,486.12 |

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信季安鑫3个月A

金额单位：人民币元

| 项目 (创金合信季安鑫3个月A) | 本期2020年06月09日至2020年06月30日 | |
|---------------------------|---------------------------|------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 634,212.93 | 634,212.93 |
| 2020-06-09基金份额折算调整 | -90,710.83 | - |
| 2020-06-09未领取红利份额折算调整(若有) | - | - |
| 2020-06-09集中申购募集资金本金及利息 | - | - |
| 2020-06-09基金拆分和集中申购完成后 | 543,502.10 | 634,212.93 |
| 本期申购 | 19.97 | 23.30 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 543,522.07 | 634,236.23 |

6.4.7.9.2 创金合信季安鑫3个月C

金额单位：人民币元

| 项目 (创金合信季安鑫3个月C) | 本期2020年06月09日至2020年06月30日 | |
|---------------------------|---------------------------|------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | - | - |
| 2020-06-09基金份额折算调整 | - | - |
| 2020-06-09未领取红利份额折算调整(若有) | - | - |
| 2020-06-09集中申购募集资金本金及利息 | - | - |

| | | |
|------------------------|----------|----------|
| 2020-06-09基金拆分和集中申购完成后 | - | - |
| 本期申购 | 1,248.20 | 1,248.20 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,248.20 | 1,248.20 |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《关于创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金基金份额转换及折算结果的公告》，本基金由创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型而来。转型方案实施后，基金份额持有人持有的创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金份额转为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金。

3. 根据《创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金基金合同》、《创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》和《创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》，本基金2020年06月09日（基金合同生效日）暂不向投资人开放基金交易。申购、转换转入及定期定额投资业务自2020年06月10日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 创金合信季安鑫3个月A

单位：人民币元

| 项目 (创金合信季安鑫3个月A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------|--------------|---------------|------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,074,543.93 | -1,164,027.11 | -89,483.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 39.46 | -42.76 | -3.30 |
| 其中：基金申购款 | 39.46 | -42.76 | -3.30 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,074,583.39 | -1,164,069.87 | -89,486.48 |

6.4.7.10.2 创金合信季安鑫3个月C

单位：人民币元

| 项目 (创金合信季安鑫3个月C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------|----------|-----------|---------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 0.99 | -0.17 | 0.82 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,674.94 | -2,673.14 | 1.80 |
| 其中：基金申购款 | 2,674.94 | -2,673.14 | 1.80 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,675.93 | -2,673.31 | 2.62 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2020年06月09日至2020年06月30日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入 | 18.92 |
| 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 | -0.08 |
| 其他 | 0.38 |
| 合计 | 19.22 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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收益——买卖差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年06月09日至2020年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 660.00 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 660.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——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 | 660.00 |

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|-------------------------|
| | 2020年06月09日至2020年06月30日 |
| 审计费用 | 300.52 |
| 信息披露费 | - |
| 汇划手续费 | - |
| 合计 | 300.52 |

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

本报告期不存在重大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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”） | 基金管理人的股东 |
| 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

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末无应付关联方的佣金。

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 2020年06月09日至2020年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 81.93 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.88 |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2020年06月09日至2020年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 32.76 |

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金于本报告期末无应付关联方的销售服务费。

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信季安鑫3个月A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2020年06月09日至2020年06月30日 |
|-----------------------------|-------------------------------|
| 基金合同生效日（2020年06月09日）持有的基金份额 | 610,125.15 |
| 报告期初持有的基金份额 | 610,125.15 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | -87,265.42 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 522,859.73 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 96.20% |

创金合信季安鑫3个月C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2020年06月09日至2020年06月30日 |
|-----------------------------|-------------------------------|
| 基金合同生效日（2020年06月09日）持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - |

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2020年06月09日至2020年06月30日 | |
|----------------|-------------------------------|--------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 股份有限公司 | 89,294.11 | 18.92 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

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、监察稽核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和债券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，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 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年06月30日 |
|--------|--------------------|
| AAA | - |
| AAA以下 | - |
| 未评级 | 451,484.00 |
| 合计 | 451,484.00 |

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2020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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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附注6.4.12。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%。于2020年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0%。

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。于2020年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为548,532.48元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2020年06月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------|-----------|------------|------|----------|------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 89,294.11 | - | - | - | 89,294.11 |
| 存出保证金 | 107.97 | - | - | - | 107.97 |
| 交易性金融资产 | - | 451,484.00 | - | - | 451,484.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,763.07 | 7,763.07 |
| 资产总计 | 89,402.08 | 451,484.00 | - | 7,763.07 | 548,649.15 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|---------|-----------|------------|---|----------|------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 117.66 | 117.66 |
| 应付托管费 | - | - | - | 44.68 | 44.68 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 0.12 | 0.12 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,486.12 | 2,486.12 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,648.58 | 2,648.58 |
| 利率敏感度缺口 | 89,402.08 | 451,484.00 | - | 5,114.49 | 546,000.57 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 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 2020年06月30日 |
| | 市场利率上升25个基点 | -1,186.01 |
| | 市场利率下降25个基点 | 1,192.07 |

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。

6.4.13.4.3 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 其他价格风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金未持有交易性权益类资产（2019年12月31日：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019年12月31日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，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中属于第二层次的余额为451,484.00元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年06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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)(转型前)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年06月08日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020年06月08日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 87,963.43 | 643,346.57 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 107.97 | 9.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 450,824.00 | 883,024.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 450,824.00 | 883,024.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,674.75 | 22,189.50 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 545,570.15 | 1,548,569.19 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020年06月08日 | 上年度末 2019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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 483,477.94 |
| 应付管理人报酬 | | 35.73 | 151.68 |
| 应付托管费 | | 11.92 | 50.56 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 2,185.60 | 5,000.00 |
| 负债合计 | | 2,233.25 | 488,680.18 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 634,212.93 | 1,243,168.20 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -90,876.03 | -183,279.19 |
| 所有者权益合计 | | 543,336.90 | 1,059,889.01 |
| 负债和所有者权益总计 | | 545,570.15 | 1,548,569.19 |

注：报告截止日2020年06月08日，基金份额净值0.857元，基金份额总额634,212.93份。

2、本基金于2020年06月09日转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金，本基金实际报告期间为2020年01月01日至2020年06月08日。

6.2 利润表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月08日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2020年01月01 日至2020年06月08 日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日 |
|----------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| 一、收入 | | 6,278.83 | 1,254.84 |
| 1. 利息收入 | | 7,923.14 | 2,247.52 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 273.68 | 193.39 |
| 债券利息收入 | | 7,649.46 | 2,054.13 |
| 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） | | -2,013.35 | -1,692.67 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -2,013.35 | -1,692.67 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.13. 3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -6,989.15 | 548.19 |
| 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 | 7,358.19 | 151.80 |
| 减：二、费用 | | 3,634.12 | 11,564.70 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2. 1 | 746.75 | 216.60 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2. | 249.05 | 72.35 |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------|------------|
| | 2 | | |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 12.72 | 2.91 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 2,625.60 | 11,272.84 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,644.71 | -10,309.86 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,644.71 | -10,309.86 |

注：本基金于2020年06月09日转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金，本基金实际报告期间为2020年01月01日至2020年06月08日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月08日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 | | |
|-----------------------------------|-------------------------------|-------------|--------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,243,168.20 | -183,279.19 | 1,059,889.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,644.71 | 2,644.71 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -608,955.27 | 89,758.45 | -519,196.82 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,273.58 | -174.46 | 1,099.12 |
| 2. 基金赎回款 | -610,228.85 | 89,932.91 | -520,295.94 |

| | | | |
|--|------------------------------------|------------|-------------|
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 634,212.93 | -90,876.03 | 543,336.90 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 796,737.28 | 19,802.46 | 816,539.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -10,309.86 | -10,309.86 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -739,722.61 | -13,363.18 | -753,085.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 72,904.70 | -662.49 | 72,242.21 |
| 2. 基金赎回款 | -812,627.31 | -12,700.69 | -825,328.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 57,014.67 | -3,870.58 | 53,144.09 |

注：本基金于2020年06月09日转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金，本基金实际报告期间为2020年01月01日至2020年06月08日。

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

黄越岷

安兆国

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

创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金（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”）《关于准予创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]3078号文）批准，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》及其配套规则和《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年1月7日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为200,122,552.48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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金于2016年1月4日至2016年1月5日募集，募集期间净认购资金人民币200,113,549.63元，认购资金在募集期间产生的利息人民币9,002.85元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,122,552.48份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第1600141号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购和新股增发。因所持可转换债券与可交换债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的利息、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月08日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 87,963.43 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 87,963.43 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末2020年06月08日 | | |
|---------------|-------|----------------|------------|-----------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 456,754.00 | 450,824.00 | -5,930.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 456,754.00 | 450,824.00 | -5,930.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 456,754.00 | 450,824.00 | -5,930.00 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月08日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 46.22 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 3.94 |
| 应收债券利息 | 6,624.59 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 6,674.75 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年06月08日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |

| | |
|------|----------|
| 预提费用 | 2,185.60 |
| 合计 | 2,185.60 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2020年01月01日至2020年06月08日 | |
|---------------------------|---------------------------|--------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,243,168.20 | 1,243,168.20 |
| 本期申购 | 1,273.58 | 1,273.58 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -610,228.85 | -610,228.85 |
| 2020年06月09日基金拆分/份 额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 634,212.93 | 634,212.93 |

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 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 | 2,085,175.43 | -2,268,454.62 | -183,279.19 |
| 本期利润 | 9,633.86 | -6,989.15 | 2,644.71 |
| 本期基金份额交易产 生的变动数 | -1,020,998.04 | 1,110,756.49 | 89,758.45 |
| 其中：基金申购款 | 2,151.53 | -2,325.99 | -174.46 |
| 基金赎回款 | -1,023,149.57 | 1,113,082.48 | 89,932.91 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,073,811.25 | -1,164,687.28 | -90,876.03 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2020年01月01日至2020年06月08日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入 | 262.26 |
| 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 | 11.19 |
| 其他 | 0.23 |
| 合计 | 273.68 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 |
|-------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -2,013.35 |
| 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 | -2,013.35 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,351,848.83 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,313,479.85 |

| | |
|----------|-----------|
| 减：应收利息总额 | 40,382.33 |
| 买卖债券差价收入 | -2,013.35 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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收益——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

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2020年01月01日至2020年06月08日 |
| 1. 交易性金融资产 | -6,989.15 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -6,989.15 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——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 | -6,989.15 |
|----|-----------|

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 7,358.19 |
| 合计 | 7,358.19 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 12.72 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 12.72 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08日 |
|-------|-------------------------------|
| 审计费用 | 2,185.60 |
| 信息披露费 | - |
| 汇划手续费 | 440.00 |
| 合计 | 2,625.60 |

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

本报告期不存在重大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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”） | 基金管理人的股东 |
| 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 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年01月01日至2020年 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 |
|-------|-------------------------|------------------------------|
| | | |

| | 06月08日 | | 06月30日 | |
|--------------|--------------|----------------|--------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1,239,735.50 | 100.00% | 1,314,994.52 | 100.00% |

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本期末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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年01月01日至2020年06月08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 2019年01月01日至2019年06月30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 | - | - | - | - |

本基金于本报告期末及上年度末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 2020年01月01日至2020年06月08日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 746.75 | 216.60 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16.44 | 84.00 |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年01月01日至2020 年06月08日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 249.05 | 72.35 |

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2020年01月01日至 2020年06月08日 | 上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日 |
|--------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额 | 610,125.15 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |

| | | |
|---------------------|------------|---|
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 610,125.15 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 96.20% | - |

6.4.10.4.2 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

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2020年01月01日至2020年06月08日 | | 上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30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 | 87,963.43 | 262.26 | 1,224.03 | 121.70 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月08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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末2020年06月08日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月08日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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、监察稽核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同责任，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和债券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，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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2020年06月08日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | - | 400,240.00 |
| 合计 | - | 400,240.00 |

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年06月08日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | 451,484.00 | 482,784.00 |
| 合计 | 451,484.00 | 482,784.00 |

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2020年6月8日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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%。于2020年6月8日，本基金未持有的流动性受限资产。

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。于2020年6月8日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为545,412.02元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2020年06月08日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------|-----------|------------|------|----------|------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 87,963.43 | - | - | - | 87,963.43 |
| 存出保证金 | 107.97 | - | - | - | 107.97 |
| 交易性金融资产 | - | 450,824.00 | - | - | 450,824.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,674.75 | 6,674.75 |
| 资产总计 | 88,071.40 | 450,824.00 | - | 6,674.75 | 545,570.15 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 35.73 | 35.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | 11.92 | 11.92 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,185.60 | 2,185.60 |

创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金（原创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型）2020 年中期报告

| | | | | | |
|-----------------|--------------|------------|------|-------------|--------------|
| 负债总计 | - | - | - | 2,233.25 | 2,233.25 |
| 利率敏感度缺口 | 88,071.40 | 450,824.00 | - | 4,441.50 | 543,336.90 |
| 上年度末2019年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 643,346.57 | - | - | - | 643,346.57 |
| 存出保证金 | 9.12 | - | - | - | 9.12 |
| 交易性金融资产 | 883,024.00 | - | - | - | 883,024.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 22,189.50 | 22,189.50 |
| 资产总计 | 1,526,379.69 | - | - | 22,189.50 | 1,548,569.19 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 483,477.94 | 483,477.94 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 151.68 | 151.68 |
| 应付托管费 | - | - | - | 50.56 | 50.56 |
| 其他负债 | - | - | - | 5,000.00 | 5,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 488,680.18 | 488,680.18 |
| 利率敏感度缺口 | 1,526,379.69 | - | - | -466,490.68 | 1,059,889.01 |

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

| 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 | 上年度末 |

| | | 2020年06月08日 | 2019年12月31日 |
|--|-------------|-------------|-------------|
| | 市场利率上升25个基点 | -1,064.67 | -410.35 |
| | 市场利率下降25个基点 | 1,066.58 | 411.63 |

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。

6.4.13.4.3 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

本基金本报告期末未持有交易性权益类投资，因此出市场利率和外汇以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年6月8日，本基金未持有交易性权益类资产(2019年12月31日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月08日，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中属于第二层次的余额为450,824.00元，无属于第一层次和第三层次的余额（2019年12月31日：第二层次883,024.00元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年06月08日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2019年12月31日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 451,484.00 | 82.29 |

| | | | |
|---|-----------------------|------------|--------|
| | 其中：债券 | 451,484.00 | 82.29 |
| | 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 | 89,294.11 | 16.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,871.04 | 1.43 |
| 9 | 合计 | 548,649.15 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 451,484.00 | 82.69 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 451,484.00 | 82.69 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|------------|--------------|
| 1 | 010107 | 21国债(7) | 4,400 | 451,484.00 | 82.69 |

7.7 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。

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 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 107.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,763.07 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,871.04 |

7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|----|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 450,824.00 | 82.63 |
| | 其中：债券 | 450,824.00 | 82.63 |
| | 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 | 87,963.43 | 16.12 |
| 8 | 其他各项资产 | 6,782.72 | 1.24 |
| 9 | 合计 | 545,570.15 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 450,824.00 | 82.97 |

| | | | |
|----|-----------|------------|-------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 450,824.00 | 82.97 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|-------|------------|--------------|
| 1 | 010107 | 21国债(7) | 4,400 | 450,824.00 | 82.97 |

7.7 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。

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 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 107.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,674.75 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,782.72 |

7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息 (转型后)

8.1 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 | 持有份额 | 占总份 |
| | | | | | | |

| | | | | 份额比例 | | 额比例 |
|-------------|-----|----------|------------|--------|-----------|---------|
| 创金合信季安鑫3个月A | 188 | 2,891.07 | 522,859.73 | 96.20% | 20,662.34 | 3.80% |
| 创金合信季安鑫3个月C | 5 | 249.64 | 0.00 | 0.00% | 1,248.20 | 100.00% |
| 合计 | 190 | 2,867.21 | 522,859.73 | 95.98% | 21,910.54 | 4.02% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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 | 创金合信季安鑫3个月A | 11,041.27 | 2.03% |
| | 创金合信季安鑫3个月C | 239.91 | 19.22% |
| | 合计 | 11,281.18 | 2.07% |

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 | 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 | 创金合信季安鑫3个月A | 0~10 |
| | 创金合信季安鑫3个月C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信季安鑫3 | 0~10 |

| | | |
|---|-------------|------|
| 金 | 个月A | |
| | 创金合信季安鑫3个月C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

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) | 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 |
| 187 | 3,391.51 | 610,125.15 | 96.20% | 24,087.78 | 3.80% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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 | 12,482.16 | 1.97% |

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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| | 创金合信季安鑫3个月A | 创金合信季安鑫3个月C |
|----------------------------|-------------|-------------|
| 基金合同生效日(2020年06月09日)基金份额总额 | 634,212.93 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 19.97 | 1,248.20 |

| | | |
|-------------------------|------------|----------|
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | -90,710.83 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 543,522.07 | 1,248.20 |

注：（1）创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金的基金份额于2020年6月9日转换为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金的基金份额，并将转换后的基金份额进行折算。

（2）用于计算折算比例的基金份额净值四舍五入保留到小数点后第9位，创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金经折算后的份额数四舍五入保留到小数点后两位，转换及折算结果请查阅基金的相关公告。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| | |
|----------------------------|--------------|
| 基金合同生效日(2016年01月07日)基金份额总额 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,243,168.20 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,273.58 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 610,228.85 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 634,212.93 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2020年05月11日表决通过了《关于创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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

本报告期内基金管理人、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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

转型后

报告期2020年06月09日 - 2020年06月30日

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 | |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

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

本基金报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

转型前

报告期2020年01月01日 - 2020年06月08日

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 | 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 | |
| | | | | | | |

| | 数量 | | | | | |
|--------|----|---|---|---|---|---|
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：交易单元的选择标准和程序：

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内退租广发证券的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 | | 基金交易 | |
|--------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 1,239,735.50 | 100.00% | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 | 创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2019年第四季度报告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-01-17 |
| 2 | 创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-04-11 |
| 3 | 创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-04-13 |
| 4 | 创金合信基金管理有限公司 | 公司官网、上海证券报 | 2020-04-14 |

| | | | |
|----|--|------------|------------|
| | 关于以通讯方式召开创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | | |
| 5 | 创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2020年第一季度报告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-04-21 |
| 6 | 创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2019年年度报告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-04-30 |
| 7 | 创金合信尊盈纯债债券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 | 公司官网、上海证券报 | 2020-05-12 |
| 8 | 创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金暂停申购、定期定额投资业务的公告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-05-12 |
| 9 | 关于《创金合信尊盈纯债债券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》的补充说明 | 公司官网、上海证券报 | 2020-05-15 |
| 10 | 关于创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金转型为创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金的提示性公告 | 公司官网、上海证券报 | 2020-05-28 |

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|------------------------|------------|------|------------|------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20200101 - 20200630 | 610,125.15 | 0.00 | 87,265.42 | 522,859.73 | 95.98% |
| 个人 | 1 | 20200101 - 20200630 | 575,279.42 | 0.00 | 575,279.42 | 0.00 | 0.00% |

| | | | | | | |
|---|--|-------|--|--|--|--|
| 人 | | 00102 | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>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。</p> <p>2、大额赎回风险</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金基金合同》、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金托管协议》、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信季安鑫3个月持有期债券型证券投资基金2020年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日