

创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 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：2023 年 10 月 24 日

目录

§1 重要提示.....	2
§2 基金产品概况.....	2
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	6
4.3 公平交易专项说明.....	7
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析.....	7
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	8
§5 投资组合报告.....	8
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	8
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	9
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	9
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细.....	9
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	9
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	10
5.11 投资组合报告附注.....	10
§6 基金中基金.....	11
6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	11
6.2 当期交易及持有基金产生的费用.....	11
6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件.....	12
§7 开放式基金份额变动.....	12
§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	13
8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	13
8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	13
§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	13
§10 影响投资者决策的其他重要信息.....	14
10.1 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.....	14
10.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	14
§11 备查文件目录.....	14
11.1 备查文件目录.....	14
11.2 存放地点.....	15
11.3 查阅方式.....	15

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 25 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）
基金主代码	018153
交易代码	018153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 7 月 25 日
报告期末基金份额总额	10,529,618.61 份
投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过大类资产配置与基金优选策略，力争实现基金资产的持续增值。
投资策略	1、大类资产配置策略。本基金拟投资的资产分为权益类资产、固收类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及偏股混合型基金等，固收类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场基金等固收类资产。本基金拟采用战略型资产配置和战术型资产配置相结合的大类资产配置策略，形成对各类资产预期收益及风险的判断，在一定范围内动态优化配置比例。1、战略型资产配置策略：在中长期时间维度内，本基金判断宏观经济发展趋势、政策导向、金融市场发展趋势，结合各类资产的长期收益率、历史波动率、资产之间的相关性、再平衡等因素，在基金合同约定范围内确定战略资产配置的最优比例。2、战术型资产配置策略：在短期时间维度内，本基金通过判断各类资产的估值水平、经济与政策环境边际变化、投资者交易结构等因素，动态评估各类资产的风险收益比与资产间的相关性，抓住相对价值变化和事件驱动带来的投资机会，回避极致分化、交易拥挤带来的投资风

	<p>险，提高组合的风险调整后收益水平。2、基金优选策略：本基金将根据基金产品特征，通过定量与定性分析相结合的方式，对基金公司、基金经理及基金产品做出综合评价。对基金公司的评价主要考虑平均业绩、管理基金的总规模及增速、管理层稳定性、投研团队配置、风控制度与落实情况、绩效考核机制等维度；对基金经理的评价主要考虑从业年限、投资理念和投资行为的一致性、收益来源及其稳定性等维度；对基金产品的评价主要考虑基金规模、历史业绩、条款设计、持有人结构等。不同类型的基金采用不同的评价体系，具体如下：（1）主动股票型基金、混合型基金：针对受基金经理主动管理影响较大的普通股票型基金和混合型基金，本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方式，优选能够持续获取稳定收益、保持稳定风格的标的进行配置。定量分析关注基金的风险收益指标、业绩归因、股债配置情况、行业配置情况、持股风格、投资集中度、换手率等指标；定性分析则关注基金经理的从业年限、投资理念和投资行为的一致性等因素，以及基金公司的投研团队、投资决策流程、风控水平、激励机制等因素。（2）主动债券型基金：针对受基金经理主动管理影响较大的债券型基金，本基金将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，综合考虑债券型基金的运作时间、资产规模、资产配置状况、风险收益指标、历史信用风险事件、费率水平、申购赎回限制、杠杆率等因素，结合基金经理投资理念、投资行为、收益稳定性等因素，以及基金公司信评团队配置、信用风险控制口径、风险处置能力等因素，力求投资组合在较低风险和良好流动性的前提下，提升产品的基础收益、平滑组合收益波动。（3）货币市场基金：货币市场基金投资策略以流动性管理以及降低投资组合整体波动率水平为目标，综合考虑货币基金的规模、收益水平、流动性、赎回机制等因素。（4）指数型基金：针对受基金经理主动管理影响较小的指数型基金，本基金将考虑基金的指数风格特征、偏离程度、流动性、费率水平等因素，选择适合的标的进行配置。（5）商品基金：本基金主要选择具备有效抵御通胀，与其他资产的相关度低的商品进行配置。在子基金的选择上，重点配置跟踪误差较小、流动性较好的产品，并合理控制投资比例及组合风险。3、股票投资策略。（1）个股投资策略。（2）港股通标的股票投资策略。（3）存托凭证的投资策略。4、固定收益品种投资策略。（1）债券投资策略。（2）资产支持证券投资策略。（3）可转换债券及可交换债券投资策略。5、其他。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证偏股型基金指数收益率*85%+中证债券型基金指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和</p>

	货币型基金中基金（FOF）。	
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	
下属分级基金的基金简称	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	018153	018154
报告期末下属分级基金的份额总额	5,037,690.53 份	5,491,928.08 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2023 年 7 月 25 日(基金合同生效日)-2023 年 9 月 30 日	
	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
1.本期已实现收益	-25,789.06	-32,176.81
2.本期利润	-48,118.82	-56,545.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0096	-0.0103
4.期末基金资产净值	4,989,483.98	5,435,381.57
5.期末基金份额净值	0.9904	0.9897

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、本基金合同生效日为 2023 年 7 月 25 日，截至本报告期末，本基金成立不满一季度。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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A

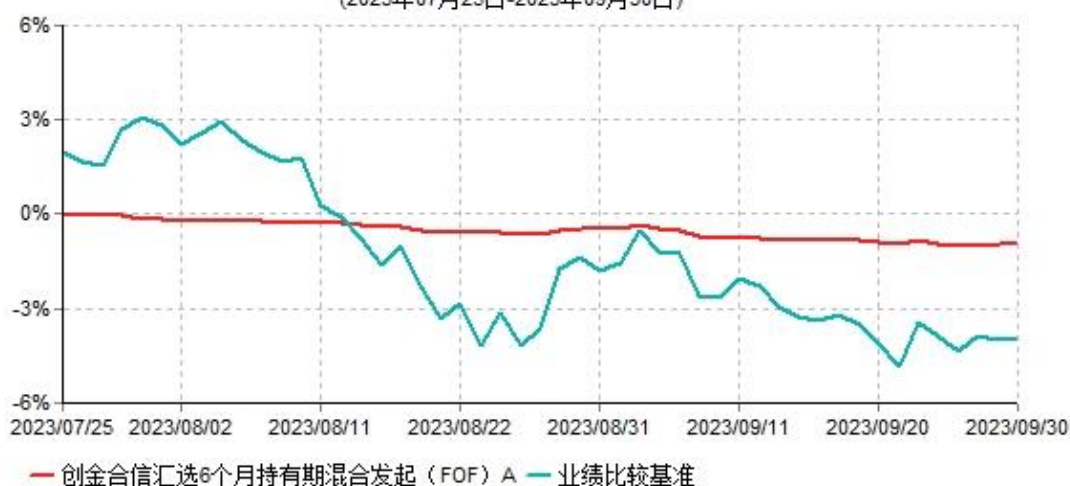
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.96%	0.07%	-3.97%	0.81%	3.01%	-0.74%

创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C

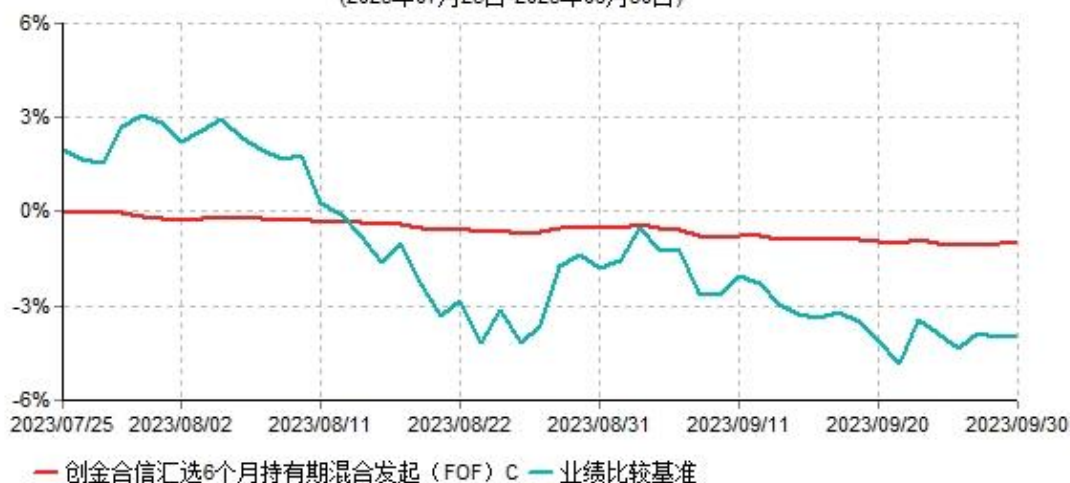
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-1.03%	0.07%	-3.97%	0.81%	2.94%	-0.74%

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

创金合信汇选6个月持有期混合发起（FOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年07月25日-2023年09月30日)



创金合信汇选6个月持有期混合发起（FOF）C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年07月25日-2023年09月30日)



注：1、本基金合同于2023年7月25日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯瑞玲	本基金基金经理	2023年7月25日	-	7	冯瑞玲女士，中国国籍，中国人民大学硕士。2016年7月加入中意资产管理有限责任公司，历任组合管理部资产配置专员、组合管理分析师，2018年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部、FOF投资一部研究员，现任基金经理。
尹海影	本基金基金经理	2023年7月25日	-	10	尹海影先生，中国国籍，麻省理工大学硕士。2011年6月加入美国摩根斯坦利有限责任公司，任固定收益部多资产交易员、分析师，2013年10月加入美国银行美林证券有限公司，任全球市场部量化交易经理，2015年2月加入美国道富基金管理有限公司，任量化与资产配置研究部助理副总经理、量化与资产配置分析师，2016年2月加入美国富达基金管理有限公司，任全球资产配置部分析师，核心投资团队成员，2017年3月加入广发基金管理有限公司，历任资产配置部投资经理、总经理助理，2020年2月加入创金合信基金管理有限公司，现任FOF投资一部副总监、基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

产品在 2023 年三季度成立建仓。期间经济的整体走势偏向弱复苏，在年末存在经济回暖或进一步的政策支持的可能性。流动性环境和货币政策预期相对温和。欧美经济目前看也比预想中更为稳健一些，软着陆和稳定修复的可能性正在提升，虽然进一步加息的情形不能排除，但抑制性加息导致经济衰退的可能性在减小。

在四季度具有投资机会的领域，包括应用科技领域和价值类投资领域。应用科技领域的产业趋势在人工智能的突破性技术进步下，正在逐步形成，包括 AI 应用、智能汽车、创新医疗等方向都在逐步孕育产业机会，同时也有希望在全球范围内提升经济运行的整体效率，降本增效，促进经济和市场的发展。从另一个角度看，中国权益市场在经历了一个相对较长的调整期后，一部分价值投资标的也已经累积了一些安全边际。如果经济出现修复回暖，那么，这些标的或相关公募基金的收益修复，也将成为高品质的投资收益来源。

产品采用稳步均匀的建仓方式。规划一个为期 4-6 个月左右的建仓期，逢低配置目标投资领域中的优质标的，包括科技类基金、价值投资基金等。产品的建仓过程，在时间上跨越今年的第三和第四季度，在这个时间阶段上，宏观经济的运行方向存在一定的不确定性。市场参与者会高度关注中国经济是否回暖以及是否有相关的经济政策出台，同时也会对欧美的经济复苏情况保持较高的敏感度。这些变化都对境内不同的权益类资产产生影响，造成持续的波动或形成新的产业趋势。新产品紧密结合这样的市场特点进行建仓，并且在没有进行权益资产投资的部分仓位用货币短债等固定收益资产进行了现金管理。结合市场

特征，产品利用略长一些的建仓时间逢低配置了 TMT、智能驾驶、制造业和消费医药等领域，力求在产业趋势形成变化的早中期结合优质标的进行建仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信汇选 6 个月持有期混合发起(FOF)A 基金份额净值为 0.9904 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.96%，同期业绩比较基准收益率为-3.97%；截至本报告期末创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C 基金份额净值为 0.9897 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.03%，同期业绩比较基准收益率为-3.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	8,977,217.96	85.89
3	固定收益投资	608,257.64	5.82
	其中：债券	608,257.64	5.82
	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	806,639.61	7.72
8	其他资产	60,182.64	0.58
9	合计	10,452,297.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	608,257.64	5.83
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	608,257.64	5.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	6,000	608,257.64	5.83

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

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编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.1 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	382.62
2	应收清算款	46,900.88
3	应收股利	12,882.36
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	16.78
7	其他	-
8	合计	60,182.64

5.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.3 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。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	006076	创金合信 恒利超短 债债券 A	契约型开 放式	923,290.3 9	1,002,693 .36	9.62	是
2	006965	财通安瑞 短债债券 A	契约型开 放式	807,259.4 4	940,457.2 5	9.02	否
3	531028	建信短债 债券 A	契约型开 放式	808,513.4 5	892,598.8 5	8.56	否
4	015832	永赢宏泰 短债 A	契约型开 放式	884,979.8 2	889,050.7 3	8.53	否
5	004545	永赢天天 利货币 A	契约型开 放式	854,820.2 2	854,820.2 2	8.20	否
6	002769	兴业聚盛 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	736,321.3 0	790,588.1 8	7.58	否
7	006852	永赢迅利 中高等级 短债债券 A	契约型开 放式	596,686.5 5	626,401.5 4	6.01	否
8	012773	嘉实超短 债债券 A	契约型开 放式	501,186.4 7	526,997.5 7	5.06	否
9	007014	嘉合磐泰 短债债券 A	契约型开 放式	389,658.7 8	424,844.9 7	4.08	否
10	011066	大成高新 技术产业 股票 C	契约型开 放式	94,376.49	348,438.0 0	3.34	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023-07-25 至 2023-09-30	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	1,892.57	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	3,033.59	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	901.09	53.11
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	5,807.62	686.53
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,399.00	282.29

注：1. 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取，并记入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

2. 当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
基金合同生效日(2023 年 7 月 25 日)基金份额总额	5,024,591.90	5,491,726.05
基金合同生效日起至报告期	13,098.63	202.03

期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期末基金份额总额	5,037,690.53	5,491,928.08

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信汇选 6 个月持有期混合发起（FOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	99.27	91.06

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.18	94.99	10,001,800.18	94.99	36 个月
基金管理人高级管理人员	13,087.71	0.12	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	10,014,887.89	95.11	10,001,800.18	94.99	36 个月

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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	20230725-20230930	10,001,800.18	0.00	0.00	10,001,800.18	94.99%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念,创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力,并在客户数量和规模上取得快速突破。2022 年 7 月,创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。截至 2023 年 9 月 30 日,创金合信基金共管理 97 只公募基金,公募管理规模 1124.96 亿元。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信汇选 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年 3 季度报告原文。

11.2 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

11.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日