

# 创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 年第 3 季度报告

2024 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2024 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.....	3
3.1 主要财务指标.....	3
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	5
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.....	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	9
§5 投资组合报告.....	9
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	9
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.....	10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	11
5.11 投资组合报告附注.....	11
§6 基金中基金.....	12
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.....	12
6.2 当期交易及持有基金产生的费用.....	13
6.3 本期报告持有的基金发生的重大影响事件.....	13
§7 开放式基金份额变动.....	14
§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	14
8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	14
8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	14
§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	14
§10 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
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.....	15
10.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
§11 备查文件目录.....	16
11.1 备查文件目录.....	16
11.2 存放地点.....	16
11.3 查阅方式.....	16

## § 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）
基金主代码	013337
交易代码	013337
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 8 日
报告期末基金份额总额	73,963,210.81 份
投资目标	本基金通过大类资产配置与基金优选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略。本基金将通过目标风险策略，以获取持续稳健的投资收益为目标，以固定收益类资产为主进行长期资产配置。同时综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估基金、股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，在一定范围内持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。2、基金投资策略。本基金通过定量分析与定性分析相结合的方式，对基金公司及其基金做出综合性评价。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、投研团队配置与离职率、风控制度与落实情况、公司受到的奖惩情况等维度；对基金的评价主要考虑历史业绩、风险指标、收益稳定性等，各类型采用不同的评价体系，具体如下：（1）债券型、货币市场基金投资策略。债券型基金投资策略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

	<p>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、运作周期等因素，结合基金经理的过往业绩表现优选基金，力求投资组合在较低风险和良好流动性的前提下，为投资者获取稳定的投资收益。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、快速赎回机制等因素。（2）股票型、混合型、指数基金投资策略。普通股票型基金和混合型基金通常采用大类资产配置及主动选股策略，为主动型基金；普通指数型基金、增强指数型基金、ETF 等以被动跟踪指数策略为主，为被动型基金。主动型基金筛选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、风格稳定的标的进行配置。定量分析关注基金的风险收益指标、业绩表现、择时和择股能力、仓位变动情况、行业配置情况、投资集中度、换手率、重仓证券等指标；定性分析则关注基金经理的投资理念、投资流程、投资风格等因素，以及基金公司的投资决策流程、风控水平、激励机制等。被动型基金筛选则主要考虑基金的指数风格特征、偏离程度、流动性、费率水平等指标，选择适合的标的进行配置。</p> <p>3、股票投资策略。4、固定收益品种投资策略。5、其他。</p>	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%	
风险收益特征	<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）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。</p> <p>本基金除可投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	013337	013338
报告期末下属分级基金的份额总额	8,464,131.61 份	65,499,079.20 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	报告期（2024 年 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日）	
	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C
1. 本期已实现收益	26,137.97	100,100.47
2. 本期利润	4,286.31	-79,755.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0006	-0.0036
4. 期末基金资产净值	8,645,671.08	66,157,052.91
5. 期末基金份额净值	1.0214	1.0100

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。

### 3.2 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

创金合信宜久来福 3 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
过去三个月	0.08%	0.04%	3.51%	0.25%	-3.43%	-0.21%
过去六个月	0.98%	0.04%	4.46%	0.21%	-3.48%	-0.17%
过去一年	1.61%	0.05%	5.48%	0.20%	-3.87%	-0.15%
自基金合同生效起至今	2.14%	0.08%	1.68%	0.22%	0.46%	-0.14%

创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C

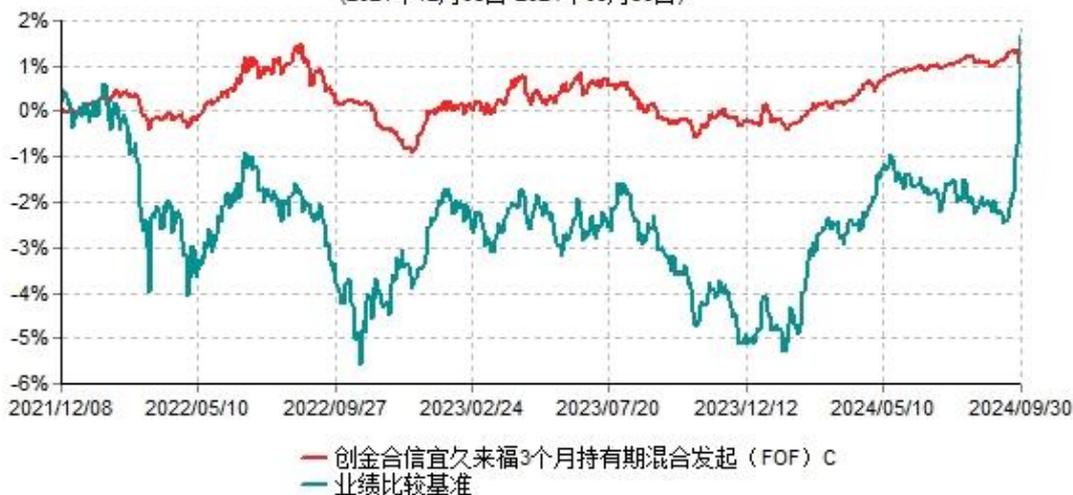
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.02%	0.04%	3.51%	0.25%	-3.53%	-0.21%
过去六个月	0.78%	0.04%	4.46%	0.21%	-3.68%	-0.17%
过去一年	1.20%	0.05%	5.48%	0.20%	-4.28%	-0.15%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.08%	1.68%	0.22%	-0.68%	-0.14%

#### 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

创金合信宜久来福3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  
(2021年12月08日-2024年09月30日)



创金合信宜久来福3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  
(2021年12月08日-2024年09月30日)



## § 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		
颜彪	本基金基金经理	2024年7月12日	-	15	颜彪先生，中国国籍，哈尔滨工业大学硕士。2008年6月加入世纪证券有限公司，历任研究所分析师、总裁办公室总裁秘

					书、资产管理部投资主办人，2016 年 8 月加入财通证券股份有限公司，任投资银行部高级副总监，2017 年 2 月加入信达澳银基金管理有限管理公司，任专户权益投资部投资经理，2020 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理、基金经理助理，现任基金经理。
尹海影	本基金基金经理、FOF 投资一部负责人（已离任）	2022 年 4 月 12 日	2024 年 7 月 12 日	11	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 投资一部负责人、基金经理。
冯瑞玲	本基金基金经理	2021 年 12 月 8 日	-	8	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。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

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 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

#### 一、三季度投资策略与组合管理情况

三季度，本产品基于多资产、多策略和多标的的三层配置框架进行配置，在可投范围内对 A 股、中债、美债和商品进行了配置，以实现在合理控制投资组合波动风险的前提下，取得长期稳健增值。

##### （1）7 月观点与运作情况

7 月，受到基于日元的套息交易快速逆转的影响，海外权益市场普遍下跌。国内居民消费走弱、专项债发行偏慢等因素导致分子端承压明显，A 股震荡下跌，中债市场持续上涨。商品层面，原油受到衰退交易的影响下跌，黄金在美联储降息预期以及国际地缘政治因素影响下继续创下新高。7 月初本产品主要配置于纯债和转债基金，受到新“国九条”和部分转债正股负面讯息的影响，为规避转债标的的尾部风险，产品 7 月中下旬逐步清仓可转债相关标的，截止 7 月底为纯债策略运作。

##### （2）8 月观点与运作情况

8 月，海外权益在美国软着陆+降息预期推动下上涨。国内有效需求不足未有明显变化，A 股震荡下跌，中债市场波动加剧，信用债和利率债先后出现调整。商品层面，中美两国需求放缓，市场对供应过剩担忧加剧，原油继续下跌，而黄金在降息预期以及国际地缘政

治因素影响下继续创下新高。本产品在 8 月仍然以纯债策略运作，在利率债回调区间逐步增配利率债相关的基金标的，拉长整体组合久期。

### （3）9 月观点与运作情况

9 月，美联储降息落地，国内政策发力带动微观预期逆转，A 股快速反弹，中债波动进一步加大，其中部分信用债产品出现流动性风险。商品层面，地缘政治冲突加剧，原油黄金均上涨。9 月中上旬，考虑到利率债调整幅度较大，同时部分信用债基的潜在流动性风险，产品在持仓上增配了部分流动性较好的信用债基标的，维持产品久期中等水平运作。同时对黄金和原油保持看多，产品小幅增配。9 月末，权益市场受到政策影响快速反弹，债券也同步调整，整体市场波动急剧加大，产品在期间小幅增配权益仓位。

## 二、四季度策略展望

四季度，我们预计仍然维持核心仓位为纯债，叠加小部分商品和权益作为卫星策略，以求实现低波稳健的风险收益特征。

后市展望上，货币信用方面，货币全面转向宽松，后续财政发力预期充足，信用层面后续有望出现扩张迹象。增长方面，受地产、消费持续拖累，8 月以来基本面弱化趋势较为明显，随着货币宽松+中央财政的发力，增长周期底部有望提前出现。通胀方面，CPI 向上的趋势似乎更为明确，而 PPI 能否完全摆脱通缩区间是向复苏前期过渡的关键因素，未来关注重点仍然是财政政策。具体到大类资产：

（1）A 股而言，四季度波动率预计仍然处于较高水平，后续财政政策的力度会对走势产生较为较大的影响，货币和财政双重发力下我们保持乐观。具体到 A 股风格方面，从胜率和赔率来考虑，当下质量风格处于最优配置位置，由于其估值水平处于较低位置，质量风格的赔率较高，同时当下高动量加中低拥挤的交易环境也具备一定胜率。上半年占优的价值风格当下处于中高胜率和低赔率水平，整体性价比受制于估值水平，我们逢低配置。大小盘风格方面，我们维持看多大盘，当前小盘拥挤度持续处于历史高位，未来的确定性较弱。

（2）中债而言，四季度债市波动或加大。8 月和 9 月的信用债的两波回调已经体现了当前信用债拥挤交易带来的脆弱性，我们在配置上会规避流动性较差的标的，以流动性较好的中短久期作为配置标的。利率债宽货币的现实压低短端，宽信用的预期拉升长端，曲线陡峭化；长端短期仍有回调压力，但长期逻辑未破坏，对于长久期利率债基我们逢低配置。可转债从估值层面具备一定性价比，但其正股退市和违约的潜在尾部风险并没有消除，我们会谨慎参与该部分投资机会。

（3）商品而言，在有色方面，坚定看好黄金的中长期投资机会，近期黄金价格对降息预期定价或已较为充分，短期可能受到部分资金止盈、机构分歧、美国大选不确定性扰动，在投资上逢低配置。铜方面也维持看多，当下宏观共振和产业需求对铜价有较强支撑。原

油方面，原油市场的短期走势高度依赖于中东局势发展，中长期需求推动依赖于全球掘金复苏，当下价格存在较强支撑。

对于本基金组合，四季度将继续按照上述逻辑进行配置，并结合市场情况进行一定的再平衡交易，以平滑净值波动。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起(FOF)A 基金份额净值为 1.0214 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%；截至本报告期末创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C 基金份额净值为 1.0100 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%。

#### 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	55,320,916.58	70.72
3	固定收益投资	6,231,520.62	7.97
	其中：债券	6,231,520.62	7.97
	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	3,000,000.00	3.84
	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	4,390,566.53	5.61
8	其他资产	9,283,373.36	11.87
9	合计	78,226,377.09	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	6,231,520.62	8.33
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	6,231,520.62	8.33

## 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	019733	24 国债 02	61,390	6,231,520.62	8.33

## 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	3,396.26
2	应收清算款	1,750,000.00
3	应收股利	2,108.76
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,527,471.05
6	其他应收款	397.29
7	其他	-
8	合计	9,283,373.36

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## § 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	161119	易方达 中债新 综指发 起式 (LOF) A	契约型 开放式	4,696,78 4.54	7,991,57 8.89	10.68	否
2	511360	海富通 中证短 融 ETF	契约型 开放式	63,300.0 0	6,991,80 1.50	9.35	否
3	006076	创金合 信恒利 超短债 债券 A	契约型 开放式	5,549,19 0.46	5,696,79 8.93	7.62	是
4	006874	创金合 信恒兴 中短债 债券 A	契约型 开放式	4,651,96 1.98	5,333,93 9.61	7.13	是
5	005951	民生加 银恒益 纯债 A	契约型 开放式	4,882,07 7.77	5,014,87 0.29	6.70	否
6	006824	创金合 信鑫日 享短债 债券 A	契约型 开放式	3,217,45 3.22	3,960,36 3.17	5.29	是
7	518880	华安黄 金易	契约型 开放式	629,700. 00	3,593,69 7.90	4.80	否

		ETF					
8	009306	平安惠 铭纯债	契约型 开放式	3,104,93 9.38	3,381,89 9.97	4.52	否
9	005754	平安短 债 A	契约型 开放式	1,472,68 8.34	1,785,92 9.15	2.39	否
10	006985	兴全恒 裕债券 A	契约型 开放式	1,197,02 9.11	1,368,68 3.08	1.83	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024-07-01 至 2024-09-30	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)	13,567.19	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	1,284.40	-
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	1,331.24	1,217.41
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	18,903.64	5,456.76
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	5,899.48	1,606.69

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	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）C
报告期期初基金份额总额	6,967,708.43	5,438,600.49
报告期期间基金总申购份额	1,521,419.25	60,193,051.43
减：报告期期间基金总赎回份额	24,996.07	132,572.72
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	8,464,131.61	65,499,079.20

## § 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	创金合信宜久来福 3 个月持有期混合发起（FOF）A	创金合信宜久来福 3 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	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	59.07	7.63

### 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	10,000,000.00	13.52	10,000,000.00	13.52	36 个月
基金管理人高级管理人员	23,691.55	0.03	-	-	-
基金经理等人员	69,712.61	0.09	121.03	0.00	36 个月
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,093,404.16	13.65	10,000,121.03	13.52	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	20240701 - 20240903	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	13.52%

#### 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,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 9 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1646.07 亿元。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、创金合信宜久来福 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 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](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日