

创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	36
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	38
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 本报告期投资基金情况	39
7.13 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 盈利投资者数量占比	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.4 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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	42
10.8 其他重大事件	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	创金合信恒睿 90 天持有期债券	
基金主代码	022807	
交易代码	022807	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 23 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	2,947,282,696.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	022807	022808
报告期末下属分级基金的份额总额	2,672,911,849.45 份	274,370,847.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
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。 1、久期配置策略 根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估，考虑在运作周期中所处阶段，确定债券组合的久期配置。本基金将在预期市场利率下行时，适当拉长债券组合的久期水平，在预期市场利率上行时，适当缩短债券组合的久期水平，以此提高债券组合的收益水平。 2、期限结构配置策略 在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，力争从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 3、债券类别配置策略 主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。 4、信用风险控制策略（含资产支持证券，下同）

	基金管理人利用行业和公司的信用研究力量，对所有投资的信用品种进行详细的分析及风险评估，依据不同信用债发行主体所处行业未来发展前景以及自身在行业内的竞争能力，对不同发行主体的债券进行内部评级分类。在实际投资中，投资人员还将结合个券流动性、到期收益率、税收因素、市场偏好等多方面因素进行个券选择，以平衡信用债投资的风险与收益。 5、跨市场套利策略 跨市场套利是根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券组合，提高投资收益，实现跨市场套利。 6、杠杆放大策略 本基金可采用杠杆放大策略扩大收益，即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益。 7、证券公司短期公司债投资策略 本基金将通过分析发行主体的公司背景、资产负债率、现金流等因素的综合考量，分析证券公司短期公司债的违约风险及合理的利差水平，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高收益。 8、衍生产品投资策略 （1）信用衍生品投资策略。（2）国债期货交易策略。 9、其他
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率×90%+ 一年期定期存款基准利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田	张姗
	联系电话	0755-82820166	400-61-95555
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	400-61-95555
传真		0755-25832571	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道时代大街 200 号创金大厦 3101	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	518052	518040
法定代表人	青美平措	缪建民

注：1. 创金合信基金管理有限公司已变更董事长，法定代表人同步变更，详见公司官网 2026 年 7 月 25 日披露的公告——《创金合信基金管理有限公司董事长变更公告》；

2. 创金合信基金管理有限公司已变更注册地址，详见公司官网 2026 年 7 月 30 日披露的公告——《创金合信基金管理有限公司关于住所变更的公告》。

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信恒睿 90 天持有期债券 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,931,085.74
本期利润	9,327,824.32
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.06%
本期基金份额净值增长率	1.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	89,634,723.43
期末可供分配基金份额利润	0.0335
期末基金资产净值	2,797,708,120.31
期末基金份额净值	1.0467
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.67%

2、创金合信恒睿 90 天持有期债券 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	1,062,075.93
本期利润	1,415,305.01
加权平均基金份额本期利润	0.0114
本期加权平均净值利润率	1.09%
本期基金份额净值增长率	1.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,356,639.74
期末可供分配基金份额利润	0.0305
期末基金资产净值	286,334,030.42
期末基金份额净值	1.0436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.36%

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

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

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信恒睿 90 天持有期债券 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	0.79%	0.03%	0.60%	0.03%	0.19%	0.00%
过去六个月	1.55%	0.02%	0.90%	0.03%	0.65%	-0.01%
过去一年	3.51%	0.02%	-0.35%	0.05%	3.86%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	4.67%	0.03%	-0.21%	0.07%	4.88%	-0.04%

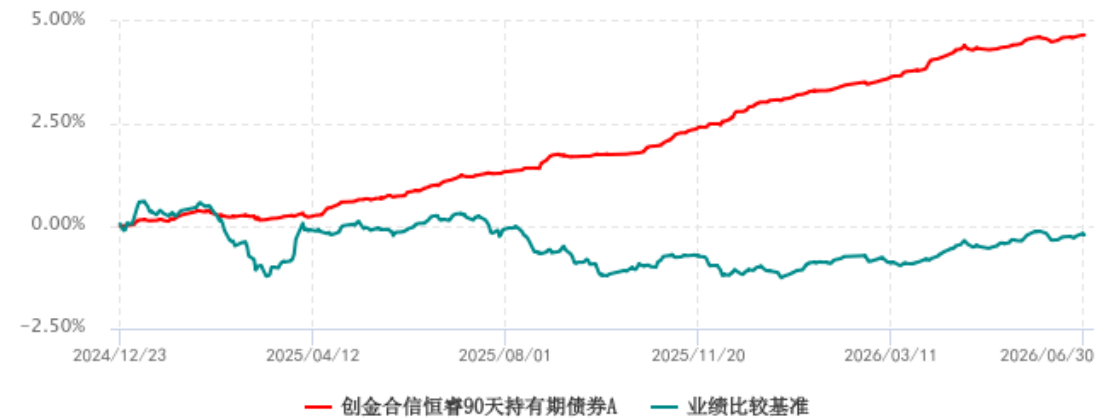
创金合信恒睿 90 天持有期债券 C

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	0.75%	0.03%	0.60%	0.03%	0.15%	0.00%
过去六个月	1.46%	0.02%	0.90%	0.03%	0.56%	-0.01%
过去一年	3.32%	0.02%	-0.35%	0.05%	3.67%	-0.03%

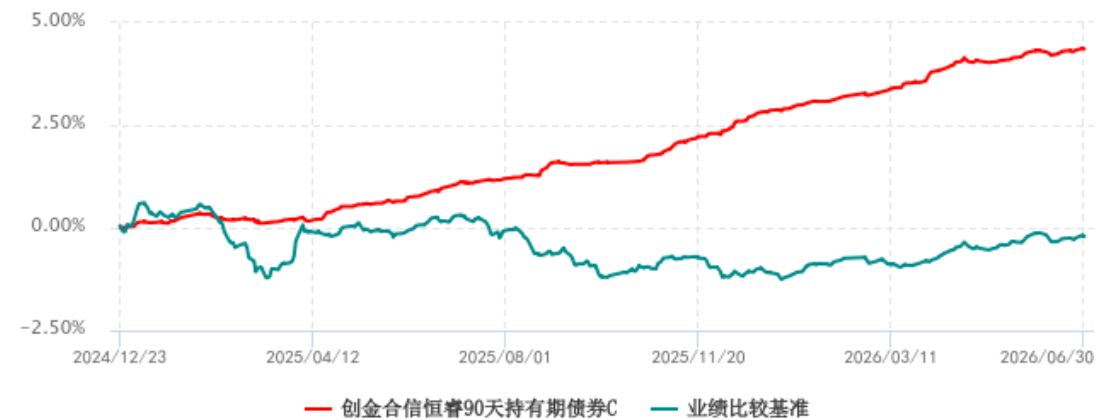
自基金合同生效起至今	4.36%	0.03%	-0.21%	0.07%	4.57%	-0.04%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

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

创金合信恒睿90天持有期债券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
(2024年12月23日-2026年06月30日)



创金合信恒睿90天持有期债券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
(2024年12月23日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）

出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张贺章	本基金基金经理、信用研究部负责人、固收策略与指数投资部副总监	2024 年 12 月 23 日	-	13	张贺章先生，中国国籍，桂林电子科技大学硕士。2011 年 6 月加入北京和君咨询有限公司，任企业管理咨询部咨询师，2012 年 8 月加入大公国际资信评估有限公司，历任工商企业二部分析师、行业组长、工商企业二部四处经理，2016 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理、固定收益部信用研究主管，现任信用研究部负责人、兼任固收策略与指数投资部副总监、基金经理、投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2026 年上半年，债券市场整体呈现震荡行情。其中一季度，债券市场收益率整体震荡波动下行，信用债表现优于利率债，3-5 年中高等级信用债整体表现较好。3 月份，受美国、以色列与伊朗之间的军事冲突影响，市场担忧油价等上涨导致输入性通胀预期以及带动 PPI 回正节奏提前，债券市场出现一定幅度波动。二季度，债券市场收益率整体震荡，从收益率曲线看，季末和季初相比，5 年品种：中债隐含评级 AA(2)城投债收益率下行 30bp，中债隐含评级 AA 城投债、中债隐含评级 AAA-银行二永债下行约 20bp；30 年国债下行约 13bp，10 年国债下行约 9bp，10 年国开下行约 18bp。4 月份上旬和中旬，受宽松的资金推动，债券收益率下行，4 月下旬 10 年和 30 年国债收益率分别下破关键点位，随着止盈情绪升温及特别国债发行计划披露，叠加资金回笼，长端出现回调，但月末在资金面宽松、通胀担忧缓解叠加经济数据不及预期的共同作用下，收益率重新下行。经济基本面方面，在经济高质量发展的定调下，呈现弱复苏，2026 年 1 月至 6 月制造业 PMI 分别为 49.3%、49%、50.4%、50.3%、50%、50.3%。货币政策方面，一季度整体上偏宽松，二季度资金波动较大。

本产品基于中短债产品的定位，以及对经济基本面、货币政策和债券市场行为的判断，进行了组合久期和杠杆调整应对，以短久期、中短久期中高等级信用债为主，主要投向区域经济发展有前景且财力还不错区域的城投债，高景气度行业的央企、国企产业债，国资控股的券商、国股大行发行的金融债等，同时运用久期、杠杆、波段操作等多个子策略力争提升产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信恒睿 90 天持有期债券 A 基金份额净值为 1.0467 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%；截至本报告期末创

金合信恒睿 90 天持有期债券 C 基金份额净值为 1.0436 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，当前经济基本面仍是弱复苏，货币政策仍是偏宽松的基调，债市经过近期震荡调整后，债券收益率有进一步下行的空间。站在目前时间点，需要持续跟踪后续全球地缘政治冲突以及对于国内经济的实际影响、接下来的财政政策、货币政策和银行间市场资金价格变化等，进而做出相应的应对。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,252,286.02	2,104,357.30
结算备付金		-	321,042.36
存出保证金		4,167.00	7,384.59
交易性金融资产	6.4.7.2	2,535,629,811.35	181,130,948.76
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,535,629,811.35	181,130,948.76
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	390,412,648.00	28,001,203.57
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		140,073,254.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,835,651.98	2,460,298.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,086,207,818.49	214,025,235.20
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,181,619.93	-
应付管理人报酬		554,932.79	15,384.17
应付托管费		177,578.48	4,922.92
应付销售服务费		44,365.90	5,451.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		59,919.36	588.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	147,251.30	156,955.17
负债合计		2,165,667.76	183,301.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,947,282,696.82	207,552,904.07
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	136,759,453.91	6,289,029.36
净资产合计		3,084,042,150.73	213,841,933.43
负债和净资产总计		3,086,207,818.49	214,025,235.20

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，创金合信恒睿 90 天持有期债券 A 份额净值 1.0467 元，基金份额总额 2,672,911,849.45 份；创金合信恒睿 90 天持有期债券 C 份额净值 1.0436 元，基金份额总额 274,370,847.37 份；总份额合计 2,947,282,696.82 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2025 年
----	-----	--------------------	----------------

		2026 年 6 月 30 日	1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,621,272.64	2,507,902.29
1.利息收入		927,576.01	1,515,296.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	38,146.42	86,646.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		889,429.59	1,428,650.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,943,728.97	1,263,533.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.16	9,943,728.97	1,263,533.92
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,749,967.66	-280,129.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-	9,201.45
减：二、营业总支出		1,878,143.31	790,506.18
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,215,194.81	323,490.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	388,862.43	103,517.12
3.销售服务费	6.4.10.2.3	125,990.19	226,877.66
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		14,938.91	18,381.07
其中：卖出回购金融资产支出		14,938.91	18,381.07
6.信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7.税金及附加		13,673.49	815.32
8.其他费用	6.4.7.25	119,483.48	117,424.16

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,743,129.33	1,717,396.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,743,129.33	1,717,396.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,743,129.33	1,717,396.11

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	207,552,904.07	-	6,289,029.36	213,841,933.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	207,552,904.07	-	6,289,029.36	213,841,933.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,739,729,792.75	-	130,470,424.55	2,870,200,217.30
（一）、综合收益总额	-	-	10,743,129.33	10,743,129.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,739,729,792.75	-	119,727,295.22	2,859,457,087.97
其中：1.基金申购款	2,939,441,017.09	-	127,798,493.38	3,067,239,510.47
2.基金赎回款	-199,711,224.34	-	-8,071,198.16	-207,782,422.50
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,947,282,696.82	-	136,759,453.91	3,084,042,150.73
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	382,287,095.20	-	126,480.75	382,413,575.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	382,287,095.20	-	126,480.75	382,413,575.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-307,372,717.89	-	633,301.86	-306,739,416.03
(一)、综合收益总额	-	-	1,717,396.11	1,717,396.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-307,372,717.89	-	-1,084,094.25	-308,456,812.14
其中：1.基金申购款	176,415.33	-	1,038.32	177,453.65
2.基金赎回款	-307,549,133.22	-	-1,085,132.57	-308,634,265.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	74,914,377.31	-	759,782.61	75,674,159.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____	____奚胜田____	____吉祥____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信恒睿 90 天持有期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”)2024 年 11 月 25 日证监许可[2024]1646 号文《关于准予创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金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《创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2024 年 12 月 23 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 382,287,095.20 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 2024 年 12 月 16 日至 2024 年 12 月 19 日募集，募集期间净认购资金人民币 382,255,360.60 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 31,734.60 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 382,287,095.20 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 2400121 号验资报告。

根据《创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费，但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额；不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下：T 日某类基金份额的基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值/T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信恒睿 90 天持有期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《创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于流动性良好的金融工具，包括债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、信用衍生品、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券，可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；

每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率 $\times$ 90%+一年期定期存款基准利率（税后） $\times$ 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6.4.4.12 外币交易

6.4.4.13 分部报告

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,252,286.02
等于：本金	3,251,460.69
加：应计利息	825.33
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,252,286.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	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	50,000,000.00	37,512.33	50,032,512.33	-5,000.00
	银行间市场	2,454,330,722.27	29,468,799.02	2,485,597,299.02	1,797,777.73
	合计	2,504,330,722.27	29,506,311.35	2,535,629,811.35	1,792,777.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,504,330,722.27	29,506,311.35	2,535,629,811.35	1,792,777.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况****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**

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	390,412,648.00	-
合计	390,412,648.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况****6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况****6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况****6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况****6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况****6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况****6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	60,703.96
其中：交易所市场	-
银行间市场	60,703.96
应付利息	-
预提费用	86,547.34
合计	147,251.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信恒睿 90 天持有期债券 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,580,227.05	172,580,227.05
本期申购	2,677,163,005.05	2,677,163,005.05
本期赎回（以“-”号填列）	-176,831,382.65	-176,831,382.65
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	2,672,911,849.45	2,672,911,849.45

创金合信恒睿 90 天持有期债券 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,972,677.02	34,972,677.02
本期申购	262,278,012.04	262,278,012.04
本期赎回（以“-”号填列）	-22,879,841.69	-22,879,841.69
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	274,370,847.37	274,370,847.37

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

创金合信恒睿 90 天持有期债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,848,102.10	1,442,020.02	5,290,122.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,848,102.10	1,442,020.02	5,290,122.12
本期利润	7,931,085.74	1,396,738.58	9,327,824.32
本期基金份额交易产	77,855,535.59	32,322,788.83	110,178,324.42

生的变动数			
其中：基金申购款	83,135,366.73	34,218,607.97	117,353,974.70
基金赎回款	-5,279,831.14	-1,895,819.14	-7,175,650.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	89,634,723.43	35,161,547.43	124,796,270.86

创金合信恒睿 90 天持有期债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	706,601.85	292,305.39	998,907.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	706,601.85	292,305.39	998,907.24
本期利润	1,062,075.93	353,229.08	1,415,305.01
本期基金份额交易产生的变动数	6,587,961.96	2,961,008.84	9,548,970.80
其中：基金申购款	7,214,716.84	3,229,801.84	10,444,518.68
基金赎回款	-626,754.88	-268,793.00	-895,547.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,356,639.74	3,606,543.31	11,963,183.05

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,454.71
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	385.04
其他	4,306.67
合计	38,146.42

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.15 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益**6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,555,495.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,611,766.36
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	9,943,728.97

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,604,712,749.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,586,001,944.60
减：应计利息总额	21,285,186.47
减：交易费用	37,385.00
买卖债券差价收入	-2,611,766.36

6.4.7.17 资产支持证券投资基金收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资基金收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资基金收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资基金收益——买卖资产支持证券差价收入**6.4.7.17.3 资产支持证券投资基金收益——赎回差价收入****6.4.7.17.4 资产支持证券投资基金收益——申购差价收入****6.4.7.18 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,749,967.66
——股票投资	-
——债券投资	1,749,967.66
——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	1,749,967.66

6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	15,038.76
信息披露费	52,208.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	20,636.14
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
公证费	3,000.00
律师费	10,000.00
合计	119,483.48

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、关联关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	65,114,961.11	100.00%	385,206,642.18	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	236,766,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,215,194.81	323,490.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	559,406.75	161,550.56
应支付基金管理人的净管理费	655,788.06	161,940.29

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	388,862.43	103,517.12

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	合计
招商银行	-	51,938.51	51,938.51
合计	-	51,938.51	51,938.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	合计
招商银行	-	226,823.06	226,823.06
合计	-	226,823.06	226,823.06

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

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

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行股份有限公司	-	10,149,860.00	-	-	-	-

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

关联方名称						
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	3,252,286.02	33,454.71	8,660,417.14	85,748.98

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.10.8.2 当期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

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，因而与货币资金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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	30,477,895.89	-
A-1 以下	-	-
未评级	304,187,060.28	37,804,993.53
合计	334,664,956.17	37,804,993.53

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	1,421,942,954.36	20,083,513.97
AAA 以下	34,493,690.95	1,060,753.86
未评级	744,528,209.87	122,181,687.40
合计	2,200,964,855.18	143,325,955.23

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来

自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本

基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,252,286.02	-	-	-	3,252,286.02
存出保证金	4,167.00	-	-	-	4,167.00
交易性金融资产	1,390,769,506.96	1,022,186,025.48	122,674,278.91	-	2,535,629,811.35
买入返售金融资产	390,412,648.00	-	-	-	390,412,648.00
应收申购款	-	-	-	16,835,651.98	16,835,651.98
应收清算款	-	-	-	140,073,254.14	140,073,254.14
资产总计	1,784,438,607.98	1,022,186,025.48	122,674,278.91	156,908,906.12	3,086,207,818.49
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,181,619.93	1,181,619.93
应付管理人报酬	-	-	-	554,932.79	554,932.79
应付托管费	-	-	-	177,578.48	177,578.48
应付销售服务费	-	-	-	44,365.90	44,365.90
应交税费	-	-	-	59,919.36	59,919.36
其他负债	-	-	-	147,251.30	147,251.30
负债总计	-	-	-	2,165,667.76	2,165,667.76
利率敏感度缺口	1,784,438.60 7.98	1,022,186.02 5.48	122,674,278. 91	154,743,238. 36	3,084,042.15 0.73
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,104,357.30	-	-	-	2,104,357.30
结算备付金	321,042.36	-	-	-	321,042.36
存出保证金	7,384.59	-	-	-	7,384.59
交易性金融资产	151,224,067. 94	20,083,513.9 7	9,823,366.85	-	181,130,948. 76
买入返售金融资产	28,001,203.5 7	-	-	-	28,001,203.5 7
应收申购款	-	-	-	2,460,298.62	2,460,298.62
资产总计	181,658,055. 76	20,083,513.9 7	9,823,366.85	2,460,298.62	214,025,235. 20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,384.17	15,384.17
应付托管费	-	-	-	4,922.92	4,922.92
应付销售服务费	-	-	-	5,451.47	5,451.47
应交税费	-	-	-	588.04	588.04
其他负债	-	-	-	156,955.17	156,955.17
负债总计	-	-	-	183,301.77	183,301.77
利率敏感度缺口	181,658,055. 76	20,083,513.9 7	9,823,366.85	2,276,996.85	213,841,933. 43

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
1.市场利率平行上升 25 个基点	-10,814,026.13	-821,105.42
2.市场利率平行下降 25 个基点	10,958,159.25	859,336.96

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	2,535,629,811.35
第三层次	-
合计	2,535,629,811.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,535,629,811.35	82.16
	其中：债券	2,535,629,811.35	82.16
	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	390,412,648.00	12.65
	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	3,252,286.02	0.11
8	其他各项资产	156,913,073.12	5.08
9	合计	3,086,207,818.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

本基金报告期内无买入股票。

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

本基金报告期内无卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,672,765,362.75	54.24
	其中：政策性金融债	419,129,260.28	13.59
4	企业债券	108,897,934.62	3.53
5	企业短期融资券	304,187,060.28	9.86
6	中期票据	449,779,453.70	14.58
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,535,629,811.35	82.22

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	072510117	25 银河证券 CP014	1,300,000	132,068,488.77	4.28
2	2128025	21 建设银行二级 01	1,100,000	113,616,287.67	3.68
3	212380008	23 交行债 01	1,100,000	112,765,556.71	3.66
4	210208	21 国开 08	1,000,000	102,579,506.85	3.33
5	212300003	23 江苏银行债 02	1,000,000	102,516,695.89	3.32

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚的情况；交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚的情况；兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚的情况；中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2

根据基金合同约定，本基金的投资范围不包括股票。

7.13.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,167.00
2	应收清算款	140,073,254.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	16,835,651.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,913,073.12

7.13.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	53,935	49,558.02	9,580,339.18	0.36%	2,663,331,510.27	99.64%
创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	5,624	48,785.71	-	-	274,370,847.37	100.00%
合计	58,871	50,063.40	9,580,339.18	0.33%	2,937,702,357.64	99.67%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	339,759.03	0.01%
	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	66.91	0.00%
	合计	339,825.94	0.01%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 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	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	0
	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	10~50
	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信恒睿 90 天持有期债券 A	创金合信恒睿 90 天持有期债券 C
基金合同生效日(2024 年 12 月 23 日)基金份额总额	45,710,628.24	336,576,466.96
本报告期期初基金份额总额	172,580,227.05	34,972,677.02
本报告期基金总申购份额	2,677,163,005.05	262,278,012.04
减：本报告期基金总赎回份额	176,831,382.65	22,879,841.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,672,911,849.45	274,370,847.37

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 2 日起，陈定坤先生担任基金管理人非职工监事，4 月 3 日起担任基金管理人监事会主席。2026 年 4 月 2 日起，宋明华先生不再担任基金管理人非职工监事、监事会主席。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及对公司运营及基金运作产生重大影响的与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人高级管理人员和相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

1、基金管理人负责选择代理本基金证券交易的证券公司，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择标准：

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构/部门和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的投研咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专项研究报告；
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (4) 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；
- (5) 合规风控能力较强，近一年无重大违法违规事项等；
- (6) 交易能力较强，具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件和信息系统，交易设施符合证券交易的需要等；
- (7) 公司认为需要考虑的其他事项。

2、证券公司及其专用交易单元的选择程序：

- (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- (2) 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

3、本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				比例		
第一创业 证券	65,114,961.11	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-31
3	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
4	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
5	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恒睿 90 天持有期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、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-17
6	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恒睿 90 天持有期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、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-18
7	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恒睿 90 天持有期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	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-20
8	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-20
9	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
10	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基	公司官网、上海证券	2026-06-25

	金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	报、中国证监会基金 电子披露网站	
11	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监 会基金电子披露网站	2026-06-25
12	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	公司官网、上海证券 报、中国证监会基金 电子披露网站	2026-06-26
13	创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同（2026 年 6 月修订）	公司官网、中国证监 会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 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	20260101 - 20260128	48,533,294.51	0.00	48,533,294.51	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险: 1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。 2、大额赎回风险 (1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险; (2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响; (3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作; (4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发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、《创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信恒睿 90 天持有期债券型证券投资基金 2026 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日