

创金合信均益量化选股混合型证券投资 基金 2025 年第 1 季度报告

2025 年 03 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 4 月 21 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..... | 5 |
| §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..... | 7 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 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 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..... | 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..... | 10 |
| 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 开放式基金份额变动..... | 12 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 12 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 12 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 12 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 12 |
| 8.1 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..... | 12 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 13 |
| §9 备查文件目录..... | 13 |
| 9.1 备查文件目录..... | 13 |
| 9.2 存放地点..... | 13 |
| 9.3 查阅方式..... | 13 |

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 4 月 17 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 2025 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 创金合信均益量化选股混合 |
| 基金主代码 | 020224 |
| 交易代码 | 020224 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 6 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 138,275,956.36 份 |
| 投资目标 | 本基金通过量化选股策略，在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略 本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。 2、股票投资策略 （1）A 股投资策略 1) 行业配置策略 本基金将采用定量与定性相结合的方法，构建有逻辑支撑和数据验证的行业配置策略。定性分析方面，根据中国经济增长的阶段和周期特征，结合国家产业政策和区域发展政策，分析细分行业的发展前景、行业竞争结构和行业盈利模式等，评估各行业的投资价值。定量分析方面，从景气度角度对各行业进行横向比较，选择基本面稳定、盈利能力强、处于相 |

| | |
|--|--|
| | <p>对高速增长阶段的行业，把握趋势性投资机会，同时从估值和交易拥挤度的角度对估值严重透支、交易过热的行业进行规避。</p> <p>2) 个股投资策略</p> <p>本基金将通过定量与定性相结合的分析方法进行个股投资。定性分析方面，择优精选出符合行业发展方向，基本面优秀、成长性好、估值合理等具有良好预期收益的 A 股上市公司股票。定量分析方面，本基金以国际通用的多因子模型为基础框架筛选 A 股上市公司股票，根据国内资本市场的特点和大量历史数据的实证检验，结合基金管理人量化团队多年定量研究与投资的经验，充分挖掘持续稳健的超额收益因子，精选并持有预期收益较好的股票构成投资组合。本基金所采用的多因子模型主要包括基本面因子、分析师因子、价量因子、事件因子等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。</p> <p>①基本面因子</p> <p>基本面因子指个股估值、盈利能力、盈利质量等方面的财务信息，代表公司的经营能力。主要包括以下指标：市盈率、市净率、营业收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、销售毛利率等。</p> <p>②分析师因子</p> <p>分析师因子指证券分析师对个股财务数据的预测信息，代表其对公司未来前景的判断。主要包括以下指标：一致预期营业收入增长率、一致预期净利润增长率、一致预期净资产收益率等。</p> <p>③价量因子</p> <p>价量因子指个股的市场行情信息，主要包括以下指标：历史收益率、历史换手率等。</p> <p>④事件因子</p> <p>事件因子指个股的公告、新闻等信息，主要包括以下指标：大股东增减持事件、并购重组事件、机构调研事件等。</p> <p>(2) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金将通过定量与定性相结合的分析方法进行港股投资。定性分析方面，择优精选出符合行业发展方向，基本面优秀、成长性好、估值合理等具有良好预期收益的港股通标的公司股票。定量分析方面，根据香港证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合香港市场的因子组合，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体</p> |
|--|--|

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | <p>组合及权重。</p> <p>(3) 投资组合优化模型</p> <p>在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，分别根据 A 股和港股通多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化，构建风险调整后的最优投资组合。</p> <p>(4) 存托凭证的投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述上市境内交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> <p>(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。</p> <p>4、金融衍生品投资/交易策略</p> <p>(1) 股指期货交易策略。(2) 股票期权投资策略。(3) 国债期货交易策略。(4) 信用衍生品投资策略。</p> <p>5、融资投资策略</p> <p>6、其他。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中证全指指数收益率×75%+中证港股通综合指数收益率(经汇率调整后)×5%+人民币活期存款利率(税后)×20% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金除可投资 A 股外，还可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信均益量化选股混合 A | 创金合信均益量化选股混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020224 | 020225 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 99,627,476.43 份 | 38,648,479.93 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（2025 年 1 月 1 日—2025 年 3 月 31 日） | |
|--------|-------------------------------------|----------------|
| | 创金合信均益量化选股混合 A | 创金合信均益量化选股混合 C |

| | | |
|----------------|----------------|---------------|
| 1.本期已实现收益 | 1,347,143.93 | 499,620.56 |
| 2.本期利润 | 2,154,178.47 | 687,913.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0200 | 0.0158 |
| 4.期末基金资产净值 | 113,981,428.91 | 44,045,224.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1441 | 1.1396 |

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

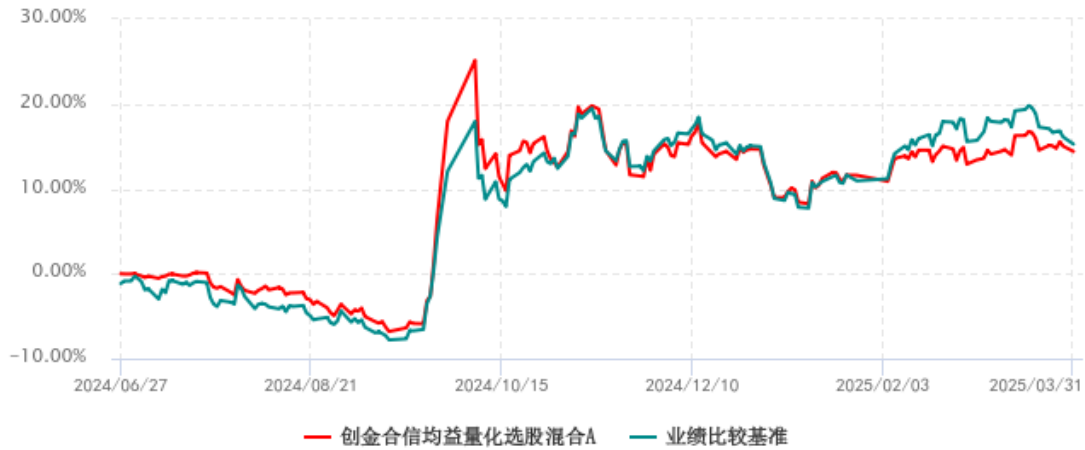
创金合信均益量化选股混合 A

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 1.48% | 0.82% | 1.97% | 0.90% | -0.49% | -0.08% |
| 过去六个月 | -3.01% | 1.44% | 2.85% | 1.24% | -5.86% | 0.20% |
| 自基金合同 生效起至今 | 14.41% | 1.52% | 15.27% | 1.28% | -0.86% | 0.24% |

创金合信均益量化选股混合 C

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 1.35% | 0.82% | 1.97% | 0.90% | -0.62% | -0.08% |
| 过去六个月 | -3.26% | 1.44% | 2.85% | 1.24% | -6.11% | 0.20% |
| 自基金合同 生效起至今 | 13.96% | 1.52% | 15.27% | 1.28% | -1.31% | 0.24% |

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

创金合信均益量化选股混合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06月27日-2025年03月31日)创金合信均益量化选股混合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06月27日-2025年03月31日)

注：1、本基金合同于 2024 年 6 月 27 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。
2、本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 | | |
| 董梁 | 本基金基金经理、首席量化投资 | 2024 年 6 月 27 日 | - | 21 | 董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003 年 12 月加入 UNX Inc 任分析师，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009 年 8 月加入瑞士 |

| | | | | | |
|----|------------|-----------------|---|---|---|
| | 官、量化指数部负责人 | | | | 信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015 年 1 月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数部负责人、基金经理。 |
| 孙悦 | 本基金基金经理 | 2024 年 6 月 27 日 | - | 7 | 孙悦先生，中国国籍，北京大学硕士。2017 年 7 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研究员、投资经理，现任基金经理、兼任投资经理。 |

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

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

4.2 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 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

2025 年一季度，国内外宏观环境发生较大变化。海外方面，特朗普正式入主白宫，签署多项关税政策，对全球贸易和经济前景造成巨大不确定性。美联储方面，鲍威尔重申不急降息。国内方面，DeepSeek 最新模型于 1 月发布，展示了国产人工智能技术的巨大进步。全国两会召开，为今年经济工作定下基调，扩内需，稳物价，实施更加积极有为的宏观政策，推动科技创新和产业创新融合发展。大类资产方面，原油价格震荡，黄金价格上涨，美元指数和美股指数下跌。国内市场行情方面，年初市场小幅调整，调整后市场显著反弹，小盘、科技板块涨幅明显，3 月中旬后，炒作情绪回落，市场向大盘、红利风格回归。

均益量化选股基金，是一只采用主动量化选股策略的基金，采用红利质量投资策略，以多策略配置的形式进行投资。经济具有周期性，市场风格也具有周期性，不同风格、行业的单一策略在不同市场环境中表现差异巨大，造成投资组合波动性较大。采用多个长期有效、同时低相关的策略进行配置投资，可以显著降低组合整体的波动，提高组合对不同环境的适应能力。对于股票来说，估值和成长性是最重要的考量因素，对于投资策略来说，同时兼顾价值与成长两种风格，是应对未来市场变化的有效策略。均益量化基金采用红利+质量的投资策略，在估值保护的前提下，追求高质量的业绩增长，在长期维度下获得稳健可持续的投资收益。产品运作层面，采用多策略+组合优化的模式，在保持对于基准指数较小偏离的同时，对各策略进行积极配置，力争获得可持续的超额收益。

2025 年 1 季度，产品净值小幅上涨。市场从 1 月初开始反弹后，投资者偏好弹性更高的小盘、科技板块，叠加国内 AI 大模型的显著进步，市场风格进一步走向极致，红利质量指数等更加偏向于基本面定价逻辑的策略相对表现较弱。展望后市，如果市场进入到以基本面定价的阶段，基金有望获得更好表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信均益量化选股混合 A 基金份额净值为 1.1441 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%；截至本报告期末创金合信均益量化选股混合 C 基金份额净值为 1.1396 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.35%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 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 | 143,739,012.92 | 90.81 |
| | 其中：股票 | 143,739,012.92 | 90.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 4,910,801.99 | 3.10 |
| 8 | 其他资产 | 9,632,138.72 | 6.09 |
| 9 | 合计 | 158,281,953.63 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 275,915.00 | 0.17 |
| B | 采矿业 | 10,190,069.00 | 6.45 |
| C | 制造业 | 95,422,395.82 | 60.38 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,398,758.00 | 4.05 |
| E | 建筑业 | 581,213.00 | 0.37 |
| F | 批发和零售业 | 1,939,382.00 | 1.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,692,981.00 | 1.70 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,781,650.96 | 3.66 |
| J | 金融业 | 12,078,591.00 | 7.64 |
| K | 房地产业 | 675,039.00 | 0.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 339,534.00 | 0.21 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,737,398.14 | 3.63 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,046,204.00 | 0.66 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 579,882.00 | 0.37 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 143,739,012.92 | 90.96 |

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 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300866 | 安克创新 | 41,500 | 4,279,480.00 | 2.71 |
| 2 | 605499 | 东鹏饮料 | 13,660 | 3,400,930.20 | 2.15 |
| 3 | 002128 | 电投能源 | 158,100 | 3,045,006.00 | 1.93 |
| 4 | 000423 | 东阿阿胶 | 49,400 | 2,986,230.00 | 1.89 |
| 5 | 601225 | 陕西煤业 | 142,800 | 2,828,868.00 | 1.79 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 99,800 | 2,775,438.00 | 1.76 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 19,200 | 2,521,920.00 | 1.60 |
| 8 | 603393 | 新天然气 | 83,500 | 2,426,510.00 | 1.54 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 1,500 | 2,341,500.00 | 1.48 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 28,700 | 2,252,950.00 | 1.43 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，内蒙古电投能源股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到通辽市生态环境局处罚的情况。

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,928,722.42 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 703,416.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 9,632,138.72 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信均益量化选股混合 A | 创金合信均益量化选股混合 C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 108,600,229.38 | 46,386,962.67 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 28,301,927.53 | 5,664,443.97 |
| 减：报告期期间基金总赎回 份额 | 37,274,680.48 | 13,402,926.71 |
| 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 | 99,627,476.43 | 38,648,479.93 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 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。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期末出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同相关约定，本基金股票投资占基金资产的比例上限高于 80%，结合本基金的投资策略和市场情况，本基金股票投资占基金资产的比例可能阶段性或长期高于 80%，将面临着较高的市场波动和投资风险，请投资者充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 2025 年 1 季度报告原文。

9.2 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

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2025 年 4 月 21 日