

# 创金合信北证 50 成份指数增强型证券 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：北京银行股份有限公司

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.....                             | 3  |
| 3.1 主要财务指标.....                                   | 4  |
| 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.....                                 | 6  |
| 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.....                              | 7  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                    | 7  |
| §5 投资组合报告.....                                    | 7  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                             | 7  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                         | 8  |
| 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.....         | 9  |
| 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<br>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.....                     | 10 |
| 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.....                           | 12 |
| §9 备查文件目录.....                                    | 12 |
| 9.1 备查文件目录.....                                   | 12 |
| 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。

基金托管人北京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       | 创金合信北证 50 成份指数增强  |
| 基金主代码      | 019993  |
| 交易代码       | 019993  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2023 年 12 月 29 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 560,502,592.99 份  |
| 投资目标       | 本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制跟踪误差的基础上，追求获得超越标的指数的回报。   |
| 投资策略       | <p>本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。</p> <p>本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。</p> <p>（1）多因子模型</p> |

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | <p>多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子，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>（2）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，根据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器，构建风险调整后的最优投资组合。</p> <p>2、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交易的股票投资策略执行，在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> <p>4、衍生产品投资/交易策略</p> <p>5、融资、转融通证券出借业务投资策略</p> <p>6、其他</p> |                    |
| 业绩比较基准          | 北证 50 成份指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%   |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。  |                    |
| 基金管理人           | 创金合信基金管理有限公司   |                    |
| 基金托管人           | 北京银行股份有限公司   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信北证 50 成份指数增强 A   | 创金合信北证 50 成份指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 019993   | 019994             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 171,847,148.05 份   | 388,655,444.94 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） |                    |
|----------------|-------------------------------------|--------------------|
|                | 创金合信北证 50 成份指数增强 A                  | 创金合信北证 50 成份指数增强 C |
| 1.本期已实现收益      | 19,222,556.70                       | 31,885,327.67      |
| 2.本期利润         | 54,570,432.21                       | 83,030,399.74      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3090                              | 0.2372             |
| 4.期末基金资产净值     | 253,328,904.36                      | 570,816,693.12     |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4742                              | 1.4687             |

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

创金合信北证 50 成份指数增强 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      | 22.94% | 2.36%     | 20.25%     | 2.44%         | 2.69%  | -0.08% |
| 过去六个月      | 46.77% | 3.84%     | 40.43%     | 3.91%         | 6.34%  | -0.07% |
| 过去一年       | 56.18% | 3.22%     | 46.23%     | 3.28%         | 9.95%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.42% | 3.01%     | 19.99%     | 3.16%         | 27.43% | -0.15% |

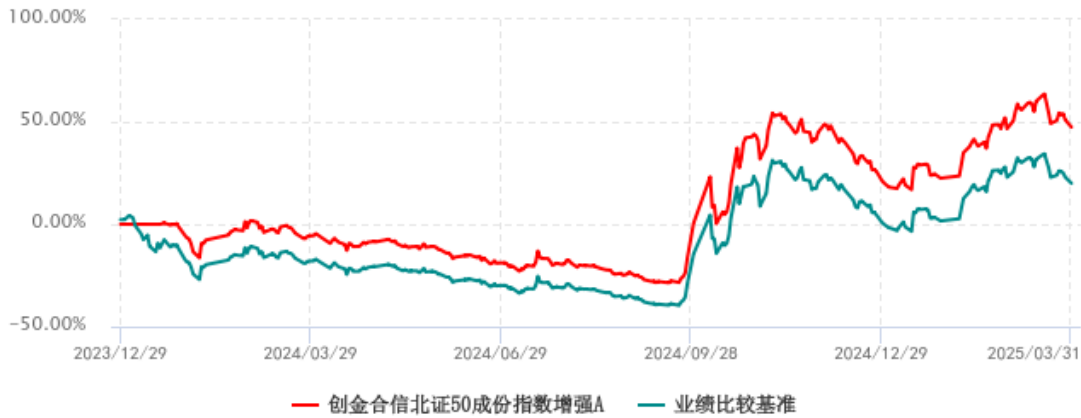
创金合信北证 50 成份指数增强 C

| 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      | 22.84% | 2.36%     | 20.25%     | 2.44%         | 2.59%  | -0.08% |
| 过去六个月      | 46.55% | 3.84%     | 40.43%     | 3.91%         | 6.12%  | -0.07% |
| 过去一年       | 55.70% | 3.22%     | 46.23%     | 3.28%         | 9.47%  | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.87% | 3.00%     | 19.99%     | 3.16%         | 26.88% | -0.16% |

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

创金合信北证50成份指数增强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12月29日-2025年03月31日)



创金合信北证50成份指数增强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12月29日-2025年03月31日)



注：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、首席量化投资官、量 | 2023 年 12 月 29 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 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 |

|     |                 |                     |   |   |  |
|-----|-----------------|---------------------|---|---|--|
|     | 化指数<br>部负责<br>人 |                     |   |   | 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。 |
| 黄小虎 | 本基金<br>基金经<br>理 | 2023 年 12<br>月 29 日 | - | 7 | 黄小虎先生，中国国籍，香港城市大学博士。2017 年 12 月加入安信证券股份有限公司，任信息技术中心数据挖掘岗，2018 年 10 月加入大成基金管理有限公司，历任战略发展部助理研究员、数量与指数投资部研究员，2021 年 1 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。                      |

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

2025 年一季度，基金的业绩基准北证 50 指数表现较好，累计上涨 22.48%。基准指数成份股内，涨幅排名靠前的行业是汽车、机械和计算机，涨幅排名靠后的行业是交通运输、建筑和通信。风格方面，高盈利和高现金流风格占优，一季度对组合超额贡献较多的风格因子包括盈利因子、估值因子和交易因子。

从宏观基本面看，国内经济数据逐渐企稳，而在产业领域，特别是科技板块如大模型、半导体等方面出现明显的创新成果，同时带动企业基本面预期和市场情绪面的快速改善，市场短期形成较好的上涨趋势。北交所作为中小企业创新发展的集中地，在当前的经济环境和市场环境中会较为受益。当前北交所估值回到中等水平，从中长期角度看，北交所代表的新兴科技发展方向是未来中国经济转型的重要方向，板块企业的盈利增长潜力在可比指数中仍然有一定的竞争力，具有较好的投资价值。

报告期内模型运行平稳，我们坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格控制各个维度上的风险暴露以限制跟踪误差，突出对北交所股票的风险监测，在此基础上追求超额收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信北证 50 成份指数增强 A 基金份额净值为 1.4742 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.94%，同期业绩比较基准收益率为 20.25%；截至本报告期末创金合信北证 50 成份指数增强 C 基金份额净值为 1.4687 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.84%，同期业绩比较基准收益率为 20.25%。

## 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              | 716,132,719.03 | 83.78  |
|   | 其中：股票             | 716,132,719.03 | 83.78  |
| 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      | 14,811,454.33  | 1.73   |
| 8 | 其他资产              | 123,816,611.74 | 14.49  |
| 9 | 合计                | 854,760,785.10 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 511,010,668.65 | 62.00        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 75,796,733.99  | 9.20         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 42,345,256.10  | 5.14         |
| 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          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 629,152,658.74 | 76.34        |

## 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 5,471,112.00  | 0.66         |
| B  | 采矿业              | 4,351,374.00  | 0.53         |
| C  | 制造业              | 54,806,403.76 | 6.65         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,483,708.21 | 1.76         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,867,462.32  | 0.95         |
| 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          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 86,980,060.29 | 10.55        |

## 5.2.3 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

## 5.3.1 报告期末指数投资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  | 835185 | 贝特瑞  | 2,397,555 | 51,978,992.40 | 6.31         |
| 2  | 832982 | 锦波生物 | 142,222   | 42,747,666.54 | 5.19         |
| 3  | 830799 | 艾融软件 | 715,735   | 40,975,828.75 | 4.97         |
| 4  | 834599 | 同力股份 | 2,030,174 | 36,969,468.54 | 4.49         |
| 5  | 430139 | 华岭股份 | 1,287,579 | 31,777,449.72 | 3.86         |
| 6  | 832522 | 纳科诺尔 | 514,826   | 28,665,511.68 | 3.48         |
| 7  | 832491 | 奥迪威  | 929,763   | 28,264,795.20 | 3.43         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 8  | 839493 | 并行科技 | 147,196 | 25,010,072.36 | 3.03 |
| 9  | 836239 | 长虹能源 | 538,398 | 21,562,839.90 | 2.62 |
| 10 | 873593 | 鼎智科技 | 421,459 | 20,364,898.88 | 2.47 |

**5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细**

| 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  | 920060 | 万源通  | 214,792 | 7,511,276.24 | 0.91         |
| 2  | 839790 | 联迪信息 | 185,575 | 7,361,760.25 | 0.89         |
| 3  | 836699 | 海达尔  | 156,284 | 7,140,615.96 | 0.87         |
| 4  | 430478 | 哈一药业 | 330,732 | 7,123,967.28 | 0.86         |
| 5  | 838227 | 美登科技 | 121,826 | 7,121,947.96 | 0.86         |

**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

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。

### 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 | 105,561,177.87 |
| 2  | 应收清算款 | -              |
| 3  | 应收股利  | -              |
| 4  | 应收利息  | -              |
| 5  | 应收申购款 | 18,255,433.87  |
| 6  | 其他应收款 | -              |
| 7  | 其他    | -              |
| 8  | 合计    | 123,816,611.74 |

### 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

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 创金合信北证 50 成份指数增强 A | 创金合信北证 50 成份指数增强 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 140,889,769.18     | 265,286,228.91     |
| 报告期期间基金总申购份额              | 354,014,029.47     | 1,059,258,040.93   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 323,056,650.60     | 935,888,824.90     |
| 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               | 171,847,148.05     | 388,655,444.94     |

§ 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

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信北证 50 成份指数增强型证券投资基金 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](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2025 年 4 月 21 日