

# 创金合信中证 500 指数增强型发起式 证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

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 7 月 20 日

§ 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责任。

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 7 月 16 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 创金合信中证 500 增强                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 002311                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 交易代码       | 002311                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2015 年 12 月 31 日                                                                                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 319,777,749.13 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 7.5%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 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。</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、债券投资策略</p> <p>本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> <p>3、存托凭证投资策略</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。</p> <p>4、衍生产品投资策略</p> <p>（1）权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。</p> <p>（2）股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>（3）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在控制信用风险的基础上，采取分散化投资的方式进行中小企业私募债的投资。基金管理人将紧密跟踪研究发债企业的基本面情况，适时调整投资组合，控制投资风险。</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                      |                  |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | 6、其他<br>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。 |                  |
| 业绩比较基准          | 中证 500 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%                                                 |                  |
| 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           | 招商银行股份有限公司                                                                           |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信中证 500 增强 A                                                                      | 创金合信中证 500 增强 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 002311                                                                               | 002316           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 108,887,389.51 份                                                                     | 210,890,359.62 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（2026 年 4 月 1 日—2026 年 6 月 30 日） |                 |
|----------------|-------------------------------------|-----------------|
|                | 创金合信中证 500 增强 A                     | 创金合信中证 500 增强 C |
| 1.本期已实现收益      | 11,778,784.43                       | 22,036,946.30   |
| 2.本期利润         | 33,339,299.39                       | 62,248,816.02   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2927                              | 0.2925          |
| 4.期末基金资产净值     | 199,279,224.67                      | 384,327,986.81  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.8301                              | 1.8224          |

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 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

创金合信中证 500 增强 A

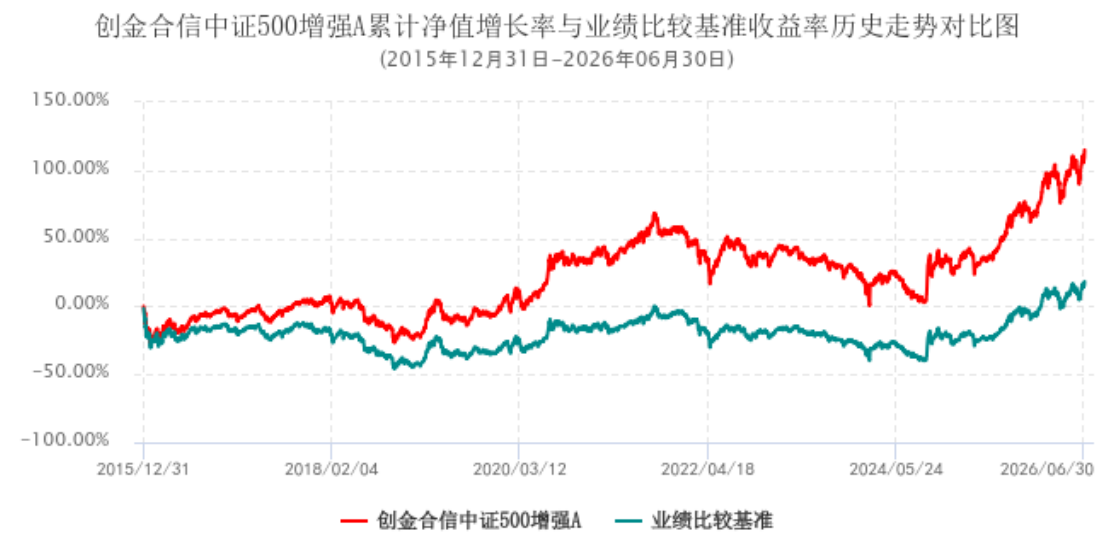
| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标 | ①-③ | ②-④ |
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

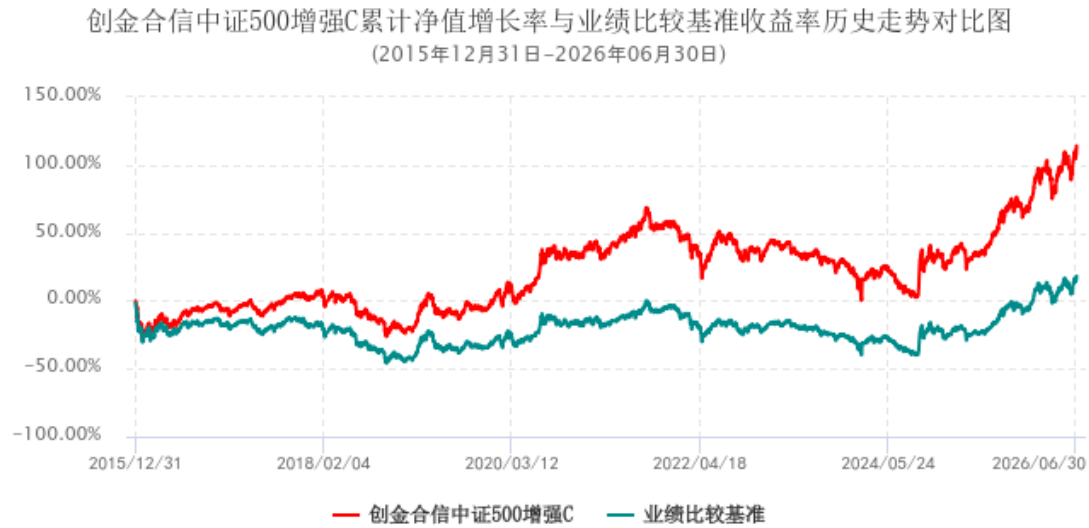
|            |         |       |        | 准差④   |        |        |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月      | 19.09%  | 1.55% | 17.63% | 1.56% | 1.46%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 21.84%  | 1.53% | 19.96% | 1.58% | 1.88%  | -0.05% |
| 过去一年       | 52.58%  | 1.30% | 49.77% | 1.35% | 2.81%  | -0.05% |
| 过去三年       | 61.44%  | 1.41% | 48.41% | 1.41% | 13.03% | 0.00%  |
| 过去五年       | 43.13%  | 1.31% | 32.00% | 1.30% | 11.13% | 0.01%  |
| 过去七年       | 134.89% | 1.30% | 79.32% | 1.29% | 55.57% | 0.01%  |
| 过去十年       | 146.08% | 1.26% | 47.30% | 1.28% | 98.78% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 114.95% | 1.34% | 18.17% | 1.35% | 96.78% | -0.01% |

创金合信中证 500 增强 C

| 阶段         | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 19.06%     | 1.55%         | 17.63%         | 1.56%                 | 1.43%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 21.78%     | 1.53%         | 19.96%         | 1.58%                 | 1.82%  | -0.05% |
| 过去一年       | 52.44%     | 1.30%         | 49.77%         | 1.35%                 | 2.67%  | -0.05% |
| 过去三年       | 60.96%     | 1.41%         | 48.41%         | 1.41%                 | 12.55% | 0.00%  |
| 过去五年       | 42.42%     | 1.31%         | 32.00%         | 1.30%                 | 10.42% | 0.01%  |
| 过去七年       | 133.12%    | 1.30%         | 79.32%         | 1.29%                 | 53.80% | 0.01%  |
| 过去十年       | 145.19%    | 1.26%         | 47.30%         | 1.28%                 | 97.89% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 114.05%    | 1.34%         | 18.17%         | 1.35%                 | 95.88% | -0.01% |

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





§ 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 李添峰 | 本基金基金经理、量化指数部总监助理        | 2023 年 3 月 4 日 | -    | 13     | 李添峰先生，中国国籍，中国人民大学硕士。2012 年 7 月加入国海证券股份有限公司，历任证券资产管理分公司量化投资研究员、产品经理，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、指数策略投资研究部投资经理、组合风险研究与服务部投资风险研究员、量化指数与国际部投资经理，现任量化指数部总监助理、基金经理。                                                                                             |
| 董梁  | 本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人 | 2019 年 7 月 5 日 | -    | 22     | 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 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。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------|

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

2026 年二季度，A 股市场整体呈现震荡分化的结构性行情，科技板块走强，红利板块承压。4 月，中东冲突尾部风险逐步消除，市场进入修复性上涨行情，4 月中下旬随着国内经济复苏数据落地、上市公司一季报业绩密集披露，基本面修复预期持续兑现，各大宽基指数全线收涨，成长风格占优，AI、半导体等硬科技板块成为资金核心布局主线。5 月和 6 月，市场延续极致分化行情，产业政策持续加持、赛道景气度持续验证，资金持续流入 AI、

半导体等硬科技板块，金融、消费等低位价值板块震荡承压，市场结构分化特征愈发显著，随着交易拥挤度的攀升，市场波动风险也在持续积累。

本基金以中证 500 指数为基准，严格按照指数增强基金的投资流程，综合考虑公司基本面、技术指标、分析师预期、事件驱动等多方面的因素，坚持自下而上进行量化选股，借助风险模型约束组合相对基准在行业、风格上的主动风险暴露，在控制跟踪误差的基础上追求长期稳健超额收益。

展望三季度，外部来看，美伊地缘局势阶段性缓和，但中东地区整体局势仍存不确定性，AI 资本开支、国际油价、海外通胀及美联储货币政策走势依旧是影响全球资本市场的核心变量，海外市场波动或持续对 A 股形成间接扰动。内部而言，国内宽松政策基调未变，经济复苏韧性持续凸显，企业中报盈利修复节奏有望加快，市场基本面支撑持续强化。预计三季度 A 股整体延续震荡上行、结构性机会为主的格局，可持续关注政策利好、业绩高增、估值合理的细分行业。中证 500 指数行业分布均衡，覆盖众多高景气中盘成长标的，兼具弹性与防御属性，契合当前结构性行情特征。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证 500 增强 A 基金份额净值为 1.8301 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.09%，同期业绩比较基准收益率为 17.63%；截至本报告期末创金合信中证 500 增强 C 基金份额净值为 1.8224 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.06%，同期业绩比较基准收益率为 17.63%。

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 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   | 546,900,749.89 | 91.48        |
|           | 其中：股票  | 546,900,749.89 | 91.48        |
| 2         | 基金投资   | -              | -            |
| 3         | 固定收益投资 | 24,303,011.51  | 4.07         |
|           | 其中：债券  | 24,303,011.51  | 4.07         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 25,743,787.85  | 4.31   |
| 8 | 其他资产              | 904,294.14     | 0.15   |
| 9 | 合计                | 597,851,843.39 | 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              | 17,420,283.00  | 2.98         |
| C  | 制造业              | 395,012,083.90 | 67.68        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,607,303.00   | 0.96         |
| E  | 建筑业              | 4,606,591.00   | 0.79         |
| F  | 批发和零售业           | 6,184,572.00   | 1.06         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 499,100.00     | 0.09         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 38,690,190.44  | 6.63         |
| J  | 金融业              | 36,826,539.00  | 6.31         |
| K  | 房地产业             | 3,622,160.00   | 0.62         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,617,460.00   | 0.62         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 6,101,872.00   | 1.05         |
| 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               | 518,188,154.34 | 88.79        |

### 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 | -          | -            |
| B  | 采矿业      | 901,761.64 | 0.15         |

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| C | 制造业              | 17,140,499.53 | 2.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 357.75        | 0.00 |
| E | 建筑业              | -             | -    |
| F | 批发和零售业           | 21,275.58     | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,951.49      | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,405,421.23  | 0.58 |
| J | 金融业              | 2,454,607.00  | 0.42 |
| 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       | 981,815.83    | 0.17 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,804,905.50  | 0.65 |
| 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               | 28,712,595.55 | 4.92 |

### 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 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  | 300604 | 长川科技 | 40,900  | 13,964,078.00 | 2.39         |
| 2  | 300223 | 北京君正 | 45,200  | 11,250,280.00 | 1.93         |
| 3  | 688019 | 安集科技 | 31,409  | 10,662,099.14 | 1.83         |
| 4  | 002409 | 雅克科技 | 46,600  | 10,461,700.00 | 1.79         |
| 5  | 688629 | 华丰科技 | 51,844  | 9,721,268.44  | 1.67         |
| 6  | 300373 | 扬杰科技 | 61,400  | 9,653,922.00  | 1.65         |
| 7  | 688002 | 睿创微纳 | 61,460  | 9,507,247.40  | 1.63         |
| 8  | 002138 | 顺络电子 | 126,800 | 9,269,080.00  | 1.59         |
| 9  | 688220 | 翱捷科技 | 74,440  | 9,254,380.80  | 1.59         |
| 10 | 688313 | 仕佳光子 | 49,792  | 9,194,092.80  | 1.58         |

### 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  | 600740 | 山西焦化 | 1,935,500 | 6,174,245.00 | 1.06         |
| 2  | 688156 | 路德科技 | 125,782   | 3,804,905.50 | 0.65         |
| 3  | 600549 | 厦门钨业 | 41,000    | 3,493,200.00 | 0.60         |
| 4  | 688428 | 诺诚健华 | 92,492    | 2,633,247.24 | 0.45         |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 71,300    | 2,048,449.00 | 0.35         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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      | 24,303,011.51 | 4.16         |
| 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        | 24,303,011.51 | 4.16         |

#### 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

| 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  | 019785 | 25 国债 13 | 240,000 | 24,303,011.51 | 4.16         |

#### 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

| 代码                | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元）      | 公允价值变动（元）  | 风险说明       |
|-------------------|--------|----------|--------------|------------|------------|
| IC2609            | IC2609 | 2        | 3,504,560.00 | 131,200.00 | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |              |            | 131,200.00 |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |              |            | 38,810.10  |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |              |            | 467,120.00 |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

## 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

### 5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同约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 | 586,931.69 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 317,362.45 |
| 6  | 其他应收款 | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 7 | 其他 | -          |
| 8 | 合计 | 904,294.14 |

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处于转股期的可转换债券。

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 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 创金合信中证 500 增强 A | 创金合信中证 500 增强 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 117,337,390.70  | 215,601,133.33  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 6,635,904.12    | 19,193,824.34   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 15,085,905.31   | 23,904,598.05   |
| 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               | 108,887,389.51  | 210,890,359.62  |

§ 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 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   | -      | -               | -      | -               | -          |
| 基金管理人高级管理人员 | 489.56 | 0.00            | -      | -               | -          |
| 基金经理等人员     | -      | -               | -      | -               | -          |
| 基金管理人股东     | -      | -               | -      | -               | -          |
| 其他          | -      | -               | -      | -               | -          |
| 合计          | 489.56 | 0.00            | 0.00   | 0.00            | -          |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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              | 20260401 - 20260630     | 107,906,026.19 | 0.00 | 0.00 | 107,906,026.19 | 33.74% |

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。

9.2 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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年 2 季度报告原文。

### 10.2 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

### 10.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2026 年 7 月 20 日