

创金合信弘科混合型发起式证券投资 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.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§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.....	9
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.....	9
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	45
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	60
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.....	60

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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	64
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信弘科混合发起	
基金主代码	025222	
交易代码	025222	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 2 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	213,404,688.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信弘科混合发起 A	创金合信弘科混合发起 C
下属分级基金的交易代码	025222	025223
报告期末下属分级基金的份 额总额	188,064,870.84 份	25,339,818.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，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 本基金将通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。 2、股票投资策略 （1）行业选择策略。（2）个股投资策略。（3）港股通标的股票投资策略。（4）存托凭证的投资策略。 3、固定收益品种投资策略 （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。 4、金融衍生品投资策略 （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。 5、融资投资策略 6、其他
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率(经汇率调整后)*10%+中债综合（全价）指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

	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。
--	---

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
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.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、创金合信弘科混合发起 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	-24,498,923.03
本期利润	-5,625,026.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0310
本期加权平均净值利润率	-2.92%
本期基金份额净值增长率	5.75%
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	-3,668,779.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0195
期末基金资产净值	207,579,369.71
期末基金份额净值	1.1038
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	10.38%

2、创金合信弘科混合发起 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	-2,573,201.48
本期利润	577,852.26
加权平均基金份额本期利润	0.0199
本期加权平均净值利润率	1.85%
本期基金份额净值增长率	5.43%
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	-583,495.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0230
期末基金资产净值	27,872,795.31
期末基金份额净值	1.1000
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	10.00%

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。

4. 本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 日, 无上年度可比期间。

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

创金合信弘科混合发起 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	12.94%	1.75%	7.68%	0.92%	5.26%	0.83%
过去六个月	5.75%	1.57%	5.85%	0.86%	-0.10%	0.71%
自基金合同 生效起至今	10.38%	1.54%	7.06%	0.81%	3.32%	0.73%

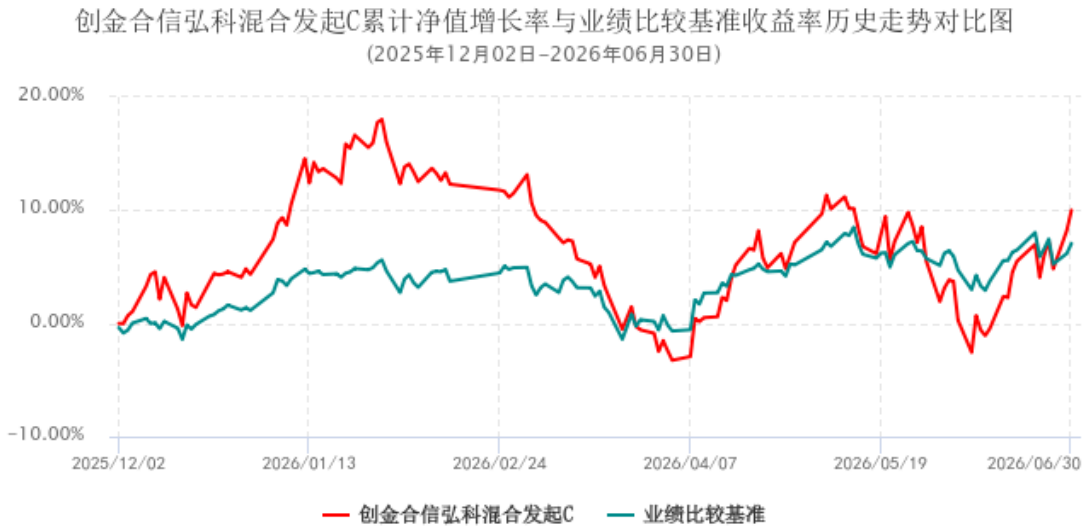
创金合信弘科混合发起 C

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	12.79%	1.75%	7.68%	0.92%	5.11%	0.83%
过去六个月	5.43%	1.57%	5.85%	0.86%	-0.42%	0.71%
自基金合同 生效起至今	10.00%	1.54%	7.06%	0.81%	2.94%	0.73%

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

创金合信弘科混合发起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
(2025年12月02日-2026年06月30日)





注：1、本基金合同于 2025 年 12 月 2 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，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		

刘扬	本基金基金经理、风格与行业投资研究部负责人	2025 年 12 月 2 日	-	12	刘扬先生，中国国籍，中国科学院遥感应用研究所硕士。2014 年 3 月加入长城证券有限责任公司，任金融研究所高级研究员，2015 年 3 月加入前海人寿保险股份有限公司，历任资产管理中心研究发展部行业研究员、权益投资部投资经理、境外投资部权益投资经理，2021 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部研究员，现任风格与行业投资研究部负责人、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 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

弘科以中观视角与中期维度进行研究，以积极均衡配置思路，立足中长期布局；深耕科技创新产业大潮，并用红利资产与传统行业龙头来平滑科技成长板块的高波动率。

产品成立于 12 月初，12-2 月份，我们积极布局春季躁动行情。春季行情科技成长板块占优，配置上侧重光交换 OCS、存储、半导体设备和 AI 应用；红利资产和传统行业龙头分化，配置上侧重有色、煤炭、保险和化工。

2 月下旬，春季归来，我们判断春季躁动即将结束，科技投资热潮或有退潮。因为，虽然 tokens 和 AI 应用的爆发拉动更多推理算力需求，其受益板块涨幅较大且动能减弱，而国产 AI 突破有所延期，市场对 AI 基建投资节奏有所担忧，地缘风险增加。因此，我们计划“减科技、降仓位、加红利”；慢慢进行降仓操作，仓位在 75% 以下；并大幅减仓科技，增加中证红利中占比较高的金融和能源、交运。

2 月 28 日，伊朗冲突爆发，其恶劣程度超过市场预期；市场风险偏好和全球流动性发生巨大转变。经过非常认真的思考，我们预测本次冲突影响重大，再次确认春季躁动结束，3 月份策略应调整“减科技、降仓位、加红利”；伊朗战争大概率不会如美国与市场所预期的“完胜、速胜”，会持续至少 4-6 周再做判断，那么油价可能会冲破 100-120，最极端情况下油价可能短暂冲破 150，且最后可能较长时间维持在 100-150 之间某个价格区间。基于此，市场可能震荡中系统性下跌，那么已经从 2025 年中持续调整的红利指数未必不同步下跌；弘科是只混合偏股型基金，需要最低仓位。因此，用红利行业增强的方式，买入叙事中受益于战争风险与油价上涨的板块，中字头央企来做底层配置，来对冲系统性震荡，或许更好；科技成长中，需要减仓高估值和高涨幅的板块，慢慢增加回调后的科技龙头与周期反转的底部品种。

事后来看，这个决定是战略上正确，战术上效果不佳。因为，所谓可能受益于伊朗战争的板块中的高股息红利（比如黄金\石化\煤炭\交运\军工），和中字头央企（金融保险、消费龙头）等，有些板块因为前期涨幅很高反而波动更大，有些配置因市场逻辑变化过快而涨跌互相对冲；我们提前减仓了科技成长，但冲突后一周科技板块反而有阶段性暴涨，特别是我们减仓了的北美 AI 链条。主要原因在于：这个配置思路并没有充分考虑前期涨幅过高的板块的回调风险，以及高估了市场对美国和伊朗战争风险的理解认知度。过去几个月简单市场下的红利资产的行业增强配置策略的有效性与超额，也会在复杂市场环节下失效。

3 月份，市场变化大，轮动快，到月底全市场下跌较多，预期变差。我们反而认为，解决问题的窗口或将来临，4 月中上旬，伊朗冲突可能会有较为重大的改变，或者美国无协议撤军、或者摩擦烈度突然加剧后缓和、或者恶劣冲突打烂仗后长期僵持。那时市场有所反应，并会意识到，无论哪种情景发生，未来发展预期如果不会趋向更差，就可能迎来市场黄金坑，之后再演绎主要经济体的宏观周期节奏。因此，我们开始储备反弹品种；

对各个重点方向进行研究，买入少量底仓，总体依然保持红利和科技的比例与总仓位不变。

进入二季度，我们及时把握 4 月黄金坑的投资机会，加强个股研究选择，增配科技，布局反弹；反弹之后，更需关注 AI 产业复杂变化和发达经济体宏观变化之中蕴含的风险与机遇。在 5-6 月的科技板块快速上涨过程中，我们在科技板块内均衡配置，不追求极致细分赛道的锐度；在其他板块面临较大的虹吸压力之后，我们逐步增加红利资产的配比，努力降低基金的收益曲线波动。

展望三季度，我们认为 5-6 月的极致科技行情的上涨动力或将减弱，科技板块内部进一步缩圈；而外围市场，特别是美联储加息预期和韩国存储链的市场波动，会对 A 股形成干扰。因此，在 6 月底，我们更加看好国产算力板块，持仓进一步聚焦到半导体设备和国产 AI 芯片上。同时，除传统的红利低波资产之外，我们增加非银、有色、煤炭、交运的资产配置；期望在震荡加剧的市场中，努力降低基金净值的波动性。

我们预计科技成长依然是最具有投资价值的产业方向之一，成长板块的投资也会经过轮动后走向更加均衡和持久。三季度是投资难度较大的时期，需要更加深入、前瞻和独立的研究与思考。进入四季度，市场走向和产业格局或将更加清晰。

综合来看，弘科的投资策略清晰，定位明确；在执行层面，面临很多复杂的问题。特别是在今年这样投资环境和产业变迁更加复杂的年份，我们会持续加强研究，特别是产业比较和资产配置的策略研究，坚持初心：长期视角，配置增强，努力用与科技板块相关系数低的资产阶段性平滑科技板块的高波动，期望可以给持有人更好的持有体验和长期的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信弘科混合发起 A 基金份额净值为 1.1038 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.75%，同期业绩比较基准收益率为 5.85%；截至本报告期末创金合信弘科混合发起 C 基金份额净值为 1.1000 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.43%，同期业绩比较基准收益率为 5.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，全球经济处于地缘冲突、能源冲击与科技革命的三重交织点，宏观叙事正式转向“再通胀下的 AI 驱动”。整体呈现“低增长、高波动、K 型分化”特征，资产定价逻辑由估值扩张切向盈利兑现与供给约束溢价。中国凭借出口与制造业韧性展现超预期抗冲击能力，形成“外需托底+AI 驱动”的结构性修复；海外美日欧央行集体步入鹰派紧缩或选择性再加息阶段；中东战局通过能源与航运重塑全球成本端通胀。AI 产业成为跨

周期关键增量，北美基建狂潮受硬约束掣肘，中国 AI 科技崛起与算力投资加速则构成产业升级与出口结构优化的核心抓手。

全球层面，地缘变量成为最大不确定性来源之一。中东局势反复通过霍尔木兹海峡航运受阻等路径产生“不对称传导”，推升全球能源价格与运价波动，导致成本端通胀回升，若冲突升级将引发供应链中断与二次通胀，延缓主要央行转鸽进程。全球流动性宽松周期终结，利率中枢系统性上移，美联储在通胀粘性与 AI 资本开支支撑的经济韧性下转向鹰派，年内降息窗口关闭甚至有进一步加息可能；欧央行受能源通胀倒逼已率先行动，下半年或再加息 1-2 次；日央行结束负利率后加速政策正常化。全球“高利率更久”格局强化，美元偏强震荡，非美货币承压，金融条件实质性收紧，估值约束与融资成本上行成为常态，全球经济面临滞胀压力与增长下调风险。

国内经济展现超预期韧性，呈“生产稳、出口强、消费弱”格局。修复基础源于外需拉动与价格链条改善，二季度实际增速虽有回落但平减指数转正，名义 GDP 增速回升强于实际，全年实现 4.5%-5% 增长目标概率较大。地产影响斜率放缓，“十五五”重大项目与“两重”建设加速形成实物工作量托底基建，货币维持适度宽松以结构性工具为主，内需修复仍是慢变量。出口与制造业构成双轮驱动，上半年出口增长显著，AI 相关商品与机电产品为核心引擎，制造业在 PPI 回升与利润修复下进入复苏通道，高技术制造业增加值增长 13.3%，新动能贡献率超 40%。依托能源结构多元化与全产业链交付能力，中国在油价波动中受输入性通胀冲击小于欧日，为全球宏观下的相对韧性资产，中国资产逻辑正从“低估值修复”向“盈利上修+国产替代”切换。

科技与 AI 领域，北美基建处于高强度中盘但硬约束浮现。北美五大云厂商 2026 年 Capex 近 9000 亿美元，同比激增，但电力缺口（2026-2028 年缺 14-20GW）、并网审批、电气设备瓶颈及劳动力短缺成为关键物理制约，市场关注点从“AI 军备竞赛 FOMO”发展到“看收入增长与供给评价”，再转向“看 ROI 回报验证”，若盈利兑现不及预期将引发估值消化。中国 AI 科技崛起与算力投资加速，政策端“人工智能+”与超大规模智算集群/算力网布局明确，未来五年全国 AI 基建总量巨大，投资增速或持续几年超越北美。国产模型能力突破且性价比凸显，获全球生态认可。国产算力芯片、服务器、光模块及液冷产业链进入规模化商用，AI 将对全要素生产率与出口结构升级形成中长期支撑，预计拉动 GDP 约 0.3-0.4 个百分点，成为对冲传统内需偏弱的关键增量。

市场策略上，大类资产配置紧扣“再通胀+AI 驱动+供给约束”。权益资产维持超配，采取哑铃型或结构优选策略，一端布局 AI 硬科技基建（光通信、半导体设备、国产芯片、电力设备及液冷），另一端配置受益于物价回升与地缘溢价的上游资源（铜、铝、能源）；A 股因“AI 基建含量”与制造韧性优于港股，港股科技龙头具重估潜力，坚持“结构优于总量”，把握算力链、高端制造、能源电力装备景气，警惕中欧贸易摩擦与地缘外溢。债券资产偏谨慎，美债收益率中枢易升难降，国内债市受供给、通胀及海外溢出约束区间震

荡。综合来看：下半年波动加剧系常态，我们建议聚焦业绩兑现能力较强的 AI 算力链、高端制造、能源装备及供给受限资源品，或能在全球再通胀与科技裂变中把握超额收益，国内“名义修复+外需强 α +AI 崛起”的三角支撑或帮助中国市场从科技牛市逐渐走向均衡慢牛。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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：创金合信弘科混合型发起式证券投资基金

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	6.4.6.1	10,465,765.38	9,418,775.37
结算备付金		4,363,836.34	2,353,882.25
存出保证金		209,521.63	8,171.30
交易性金融资产	6.4.6.2	227,843,189.64	68,084,290.25
其中：股票投资		215,084,108.60	64,261,375.73
基金投资		-	-
债券投资		12,759,081.04	3,822,914.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,731,539.73	-
应收股利		106,303.24	-
应收申购款		8,271.46	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		244,728,427.42	79,865,119.17

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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,660,981.71	5,112,152.60
应付赎回款		530,742.55	-
应付管理人报酬		232,847.31	69,968.87
应付托管费		38,807.91	11,661.49
应付销售服务费		13,415.39	12,457.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	799,467.53	114,850.01
负债合计		9,276,262.40	5,321,090.96
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	213,404,688.95	71,427,848.11
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	22,047,476.07	3,116,180.10
净资产合计		235,452,165.02	74,544,028.21
负债和净资产总计		244,728,427.42	79,865,119.17

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，创金合信弘科混合发起 A 份额净值 1.1038 元，基金份额总额 188,064,870.84 份；创金合信弘科混合发起 C 份额净值 1.1000 元，基金份额总额 25,339,818.11 份；总份额合计 213,404,688.95 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信弘科混合型发起式证券投资基金

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 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,327,070.85
1.利息收入		30,916.07
其中：存款利息收入	6.4.6.9	30,916.07
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		
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,595,223.63
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-26,476,321.44
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.12	77,222.42
资产支持证券投资收益	6.4.6.13	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-
股利收益	6.4.6.16	803,875.39
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）	6.4.6.17	22,024,950.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	212,286.25
减：二、营业总支出		1,720,103.20
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	1,329,423.50
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.9.2.2	221,570.64
3.销售服务费	6.4.9.2.3	93,744.59
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.6.19	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.6.20	75,364.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,047,174.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,047,174.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-5,047,174.05

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信弘科混合型发起式证券投资基金

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	71,427,848.11	-	3,116,180.10	74,544,028.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,427,848.11	-	3,116,180.10	74,544,028.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	141,976,840.84	-	18,931,295.97	160,908,136.81
（一）、综合收益总额	-	-	-5,047,174.05	-5,047,174.05
（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）	141,976,840.84	-	23,978,470.02	165,955,310.86
其中：1.基金申购款	225,903,627.32	-	29,983,199.08	255,886,826.40
2.基金赎回款	-83,926,786.48	-	-6,004,729.06	-89,931,515.54
（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	213,404,688.95	-	22,047,476.07	235,452,165.02

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 2 日，无上年度可比期间。

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 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。

6.4.2 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。

6.4.3 重要会计政策和会计估计

6.4.3.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日和 2025 年 12 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

6.4.3.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.3.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的

按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.3.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.3.11 基金的收益分配政策

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可每月进行分红评估并根据实际情况制定收益分配方案，具体分配方案以公告为准；若《基金合同》生效不满 6 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(d) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.3.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.3.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.3.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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股票、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) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 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	10,465,765.38

等于：本金	10,465,093.84
加：应计利息	671.54
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	10,465,765.38

6.4.6.2 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	193,091,585.07	-	215,084,108.60	21,992,523.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	12,607,339.29	12,759,081.04	-4,819.29
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,607,339.29	12,759,081.04	-4,819.29
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	205,698,924.36	156,561.04	227,843,189.64	21,987,704.24

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 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。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.6.6 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	1,251.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	732,221.65
其中：交易所市场	732,221.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	65,994.06
合计	799,467.53

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信弘科混合发起 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	45,988,548.81	45,988,548.81
本期申购	210,335,161.31	210,335,161.31
本期赎回（以“-”号填列）	-68,258,839.28	-68,258,839.28
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	188,064,870.84	188,064,870.84

创金合信弘科混合发起 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	25,439,299.30	25,439,299.30
本期申购	15,568,466.01	15,568,466.01
本期赎回（以“-”号填列）	-15,667,947.20	-15,667,947.20
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	25,339,818.11	25,339,818.11

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信弘科混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,038,600.46	-24,123.03	2,014,477.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,038,600.46	-24,123.03	2,014,477.43
本期利润	-24,498,923.03	18,873,896.72	-5,625,026.31
本期基金份额交易产生的变动数	18,791,543.13	4,333,504.62	23,125,047.75
其中：基金申购款	20,237,653.86	7,663,054.71	27,900,708.57
基金赎回款	-1,446,110.73	-3,329,550.09	-4,775,660.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,668,779.44	23,183,278.31	19,514,498.87

创金合信弘科混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,114,825.86	-13,123.19	1,101,702.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,114,825.86	-13,123.19	1,101,702.67
本期利润	-2,573,201.48	3,151,053.74	577,852.26
本期基金份额交易产生的变动数	874,880.57	-21,458.30	853,422.27
其中：基金申购款	1,481,128.42	601,362.09	2,082,490.51
基金赎回款	-606,247.85	-622,820.39	-1,229,068.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-583,495.05	3,116,472.25	2,532,977.20

6.4.6.9 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	25,082.24
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	5,603.75
其他	230.08
合计	30,916.07

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-26,476,321.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-26,476,321.44

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,370,837,387.31
减：卖出股票成本总额	1,394,945,295.20
减：交易费用	2,368,413.55
买卖股票差价收入	-26,476,321.44

6.4.6.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.6.12 债券投资收益

6.4.6.12.1 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	78,182.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-959.71
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	77,222.42

6.4.6.12.2 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	2,326,918.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,301,339.71
减：应计利息总额	26,538.05
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-959.71

6.4.6.13 资产支持证券投资收益

6.4.6.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 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。

6.4.6.15.2 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。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	803,875.39
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	803,875.39

6.4.6.17 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	22,024,950.46
——股票投资	22,027,983.75
——债券投资	-3,033.29
——资产支持证券投资	-
——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	22,024,950.46

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	186,136.58
转换费收入	26,149.67
合计	212,286.25

6.4.6.19 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.6.20 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	13,785.48
信息披露费	52,208.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,370.41
合计	75,364.47

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方、关联关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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、基金代销机构
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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	578,359,788.37	19.98%

6.4.9.1.2 债券交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	263,212.09	19.99%	260,071.74	35.52%

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,329,423.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	626,690.10
应支付基金管理人的净管理费	702,733.40

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

1.2%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×1.2%/当年天数。

6.4.9.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	221,570.64

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	创金合信弘科混合发起 A	创金合信弘科混合发起 C	合计
创金合信直销	-	16,760.53	16,760.53
招商银行	-	76,904.22	76,904.22
合计	-	93,664.75	93,664.75

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 0.6%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×0.6%/当年天数。
销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	创金合信弘科混合发起 A	创金合信弘科混合发起 C
报告期初持有的基金份额	5,001,050.21	5,001,050.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,001,050.21	5,001,050.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.66%	19.74%

基金管理人投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	10,465,765.38	25,082.24

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。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明**6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况**6.4.10.1 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。

6.4.11 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	1-6 个月（含）	新股锁定	19.68	141.49	400	7,872.00	56,596.00	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月（含）	新股锁定	44.56	468.67	95	4,233.20	44,523.65	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	40.98	308.19	122	4,999.56	37,599.18	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月（含）	新股锁定	26.28	172.09	204	5,361.12	35,106.36	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	1-6 个月（含）	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	新股锁定	17.70	84.32	181	3,203.70	15,261.92	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	1-6 个月（含）	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	1-6 个月（含）	新股锁定	27.19	31.31	294	7,993.86	9,205.14	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	1-6 个月（含）	新股锁定	30.38	38.99	206	6,258.28	8,031.94	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月（含）	新股锁定	53.26	58.74	119	6,337.94	6,990.06	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月（含）	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	1-6 个月（含）	新股锁定	33.49	33.93	51	1,707.99	1,730.43	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新

股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.11.4 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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约责任，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。

6.4.12.2.1 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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,759,081.04	3,822,914.52
合计	12,759,081.04	3,822,914.52

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。

6.4.12.2.2 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。

6.4.12.2.3 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。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.12.2.5 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。

6.4.12.2.6 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。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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时间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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.12.4.1.1 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	10,465,765.38	-	-	-	10,465,765.38
结算备付金	4,363,836.34	-	-	-	4,363,836.34
存出保证金	209,521.63	-	-	-	209,521.63
交易性金融资产	12,759,081.04	-	-	215,084,108.60	227,843,189.64
应收股利	-	-	-	106,303.24	106,303.24
应收申购款	-	-	-	8,271.46	8,271.46
应收清算款	-	-	-	1,731,539.73	1,731,539.73
资产总计	27,798,204.39	-	-	216,930,223.03	244,728,427.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	530,742.55	530,742.55
应付管理人	-	-	-	232,847.31	232,847.31

报酬					
应付托管费	-	-	-	38,807.91	38,807.91
应付销售服务费	-	-	-	13,415.39	13,415.39
应付清算款	-	-	-	7,660,981.71	7,660,981.71
其他负债	-	-	-	799,467.53	799,467.53
负债总计	-	-	-	9,276,262.40	9,276,262.40
利率敏感度缺口	27,798,204.39	-	-	207,653,960.63	235,452,165.02
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	9,418,775.37	-	-	-	9,418,775.37
结算备付金	2,353,882.25	-	-	-	2,353,882.25
存出保证金	8,171.30	-	-	-	8,171.30
交易性金融资产	3,822,914.52	-	-	64,261,375.73	68,084,290.25
资产总计	15,603,743.44	-	-	64,261,375.73	79,865,119.17
负债					
应付清算款	-	-	-	5,112,152.60	5,112,152.60
应付管理人报酬	-	-	-	69,968.87	69,968.87
应付托管费	-	-	-	11,661.49	11,661.49
应付销售服务费	-	-	-	12,457.99	12,457.99
其他负债	-	-	-	114,850.01	114,850.01
负债总计	-	-	-	5,321,090.96	5,321,090.96
利率敏感度缺口	15,603,743.44	-	-	58,940,284.77	74,544,028.21

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。

6.4.12.4.1.2 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	-2,161.23	-5,321.13
	2.市场利率平行下降 25 个基点	2,164.10	5,331.42

6.4.12.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	27,139,043.35	-	-	-	27,139,043.35
应收股利	-	106,303.24	-	-	-	106,303.24
资产合计	-	27,245,346.59	-	-	-	27,245,346.59
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	27,245,346.59	-	-	-	27,245,346.59

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	12,771,788.22	-	-	-	12,771,788.22
资产合计	-	12,771,788.22	-	-	-	12,771,788.22
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,771,788.22	-	-	-	12,771,788.22

6.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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. 所有外币相对人民币升值 5%	1,362,267.33	638,589.41
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,362,267.33	-638,589.41

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	215,084,108.60	91.35	64,261,375.73	86.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	215,084,108.60	91.35	64,261,375.73	86.21

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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.业绩比较基准上升 5%	16,030,218.61	6,547,591.57
2.业绩比较基准下降 5%	-16,030,218.61	-6,547,591.57

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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	214,834,017.64
第二层次	12,759,081.04
第三层次	250,090.96
合计	227,843,189.64

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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)。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	215,084,108.60	87.89
	其中：股票	215,084,108.60	87.89
2	固定收益投资	12,759,081.04	5.21
	其中：债券	12,759,081.04	5.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,829,601.72	6.06
7	其他各项资产	2,055,636.06	0.84
8	合计	244,728,427.42	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 27,139,043.35 元，占净值比为 11.53%。

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**

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	102,646,032.73	43.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,374,142.00	6.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,231,980.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,271,461.52	1.81

J	金融业	60,421,449.00	25.66
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	-	-
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	187,945,065.25	79.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	3,144,133.63	1.34
信息技术	23,994,909.72	10.19
合计	27,139,043.35	11.53

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

金额单位：人民币元

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	688981	中芯国际	119,013	18,901,644.66	8.03
2	H01347	华虹宏力	101,000	18,878,107.96	8.02
3	688012	中微公司	27,123	12,707,125.50	5.40
4	002142	宁波银行	394,000	11,697,860.00	4.97
5	600707	彩虹股份	587,200	9,917,808.00	4.21
6	601985	中国核电	1,006,600	9,089,598.00	3.86
7	000776	广发证券	353,200	8,264,880.00	3.51
8	600900	长江电力	275,200	7,284,544.00	3.09
9	688652	京仪装备	36,365	7,279,182.05	3.09
10	688200	华峰测控	13,804	7,248,480.40	3.08
11	600030	中信证券	246,500	7,081,945.00	3.01
12	688469	芯联集成	656,576	6,966,271.36	2.96
13	300567	精测电子	21,100	6,701,360.00	2.85
14	601995	中金公司	146,700	5,303,205.00	2.25
15	688361	中科飞测	12,000	5,160,000.00	2.19

16	H02513	智谱	2,800	5,116,801.76	2.17
17	601336	新华保险	82,600	4,927,916.00	2.09
18	688396	华润微	50,000	4,877,500.00	2.07
19	300776	帝尔激光	20,700	4,449,672.00	1.89
20	601328	交通银行	671,500	4,317,745.00	1.83
21	688507	索辰科技	15,839	4,271,461.52	1.81
22	601998	中信银行	613,800	4,253,634.00	1.81
23	601006	大秦铁路	918,000	4,231,980.00	1.80
24	601288	农业银行	696,800	4,229,576.00	1.80
25	601988	中国银行	733,000	4,192,760.00	1.78
26	688192	迪哲医药	100,000	3,993,000.00	1.70
27	601166	兴业银行	227,300	3,764,088.00	1.60
28	H09992	泡泡玛特	23,400	3,144,133.63	1.34
29	601216	君正集团	700,600	3,124,676.00	1.33
30	688766	普冉股份	3,483	2,670,067.80	1.13
31	300433	蓝思科技	48,500	2,602,510.00	1.11
32	601211	国泰海通	131,200	2,387,840.00	1.01
33	600552	凯盛科技	69,300	2,257,794.00	0.96
34	603061	金海通	3,500	1,757,770.00	0.75
35	000725	京东方 A	180,000	1,562,400.00	0.66
36	600487	亨通光电	2,000	218,680.00	0.09
37	688820	盛合晶微	400	56,596.00	0.02
38	688797	臻宝科技	95	44,523.65	0.02
39	688635	长进光子	122	37,599.18	0.02
40	688813	泰金新能	204	35,106.36	0.01
41	688811	有研新材	834	20,124.42	0.01
42	603459	红板科技	181	15,261.92	0.01
43	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
44	001365	天海电子	294	9,205.14	0.00
45	001393	维通利	206	8,031.94	0.00
46	001237	惠康科技	119	6,990.06	0.00
47	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
48	603293	埃泰克	51	1,730.43	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688981	中芯国际	26,055,503.69	34.95
2	600547	山东黄金	24,029,003.00	32.23
2	H01787	山东黄金	1,429,701.50	1.92

3	002142	宁波银行	24,423,884.03	32.76
4	688195	腾景科技	21,991,551.63	29.50
5	300661	圣邦股份	21,691,439.56	29.10
6	300620	光库科技	21,150,892.69	28.37
7	688256	寒武纪	18,768,304.75	25.18
8	002155	湖南黄金	17,030,400.00	22.85
9	002475	立讯精密	16,806,378.00	22.55
10	H01347	华虹宏力	16,426,680.23	22.04
11	601088	中国神华	16,063,709.00	21.55
12	688008	澜起科技	15,672,866.82	21.02
13	600938	中国海油	10,344,532.00	13.88
13	H00883	中国海洋石油	5,172,209.76	6.94
14	601336	新华保险	15,059,036.00	20.20
15	H09988	阿里巴巴-W	15,058,307.54	20.20
16	002281	光迅科技	14,978,266.00	20.09
17	601601	中国太保	14,692,517.31	19.71
18	600028	中国石化	14,453,227.00	19.39
19	688205	德科立	14,341,661.40	19.24
20	600900	长江电力	12,914,408.00	17.32
21	688608	恒玄科技	12,854,452.51	17.24
22	601998	中信银行	12,747,834.40	17.10
23	688615	合合信息	12,455,653.76	16.71
24	002837	英维克	12,343,738.24	16.56
25	688385	复旦微电	10,090,611.09	13.54
25	H01385	上海复旦	1,934,950.16	2.60
26	600256	广汇能源	11,645,737.00	15.62
27	601225	陕西煤业	11,547,826.40	15.49
28	600048	保利发展	11,318,547.00	15.18
29	300548	长芯博创	11,291,753.00	15.15
30	688507	索辰科技	11,246,784.44	15.09
31	601838	成都银行	11,238,733.00	15.08
32	688536	思瑞浦	10,723,363.12	14.39
33	300502	新易盛	10,704,786.00	14.36
34	688766	普冉股份	10,678,520.33	14.33
35	600584	长电科技	10,651,987.00	14.29
36	688525	佰维存储	10,260,390.78	13.76
37	688192	迪哲医药	10,004,763.70	13.42
38	688012	中微公司	9,927,290.70	13.32
39	601398	工商银行	9,843,070.77	13.20
40	601318	中国平安	9,538,394.00	12.80
41	300059	东方财富	9,436,210.66	12.66
42	688702	盛科通信	9,383,668.69	12.59
43	000776	广发证券	9,307,514.00	12.49

44	600362	江西铜业	7,518,486.00	10.09
44	H00358	江西铜业股份	1,720,100.39	2.31
45	601985	中国核电	9,111,409.00	12.22
46	688777	中控技术	9,027,073.47	12.11
47	688041	海光信息	8,934,631.98	11.99
48	601077	渝农商行	8,709,591.00	11.68
49	601628	中国人寿	8,636,217.00	11.59
50	H01024	快手－W	8,590,350.89	11.52
51	600707	彩虹股份	8,498,971.00	11.40
52	688519	南亚新材	8,479,466.37	11.38
53	000830	鲁西化工	8,352,013.45	11.20
54	601728	中国电信	8,348,225.00	11.20
55	601919	中远海控	5,491,743.00	7.37
55	H01919	中远海控	2,856,231.80	3.83
56	688802	沐曦股份	8,319,053.87	11.16
57	002916	深南电路	8,275,331.00	11.10
58	601166	兴业银行	8,249,208.98	11.07
59	002384	东山精密	8,215,323.00	11.02
60	688200	华峰测控	8,212,305.49	11.02
61	603993	洛阳钼业	5,321,490.00	7.14
61	H03993	洛阳钼业	2,831,597.24	3.80
62	300253	卫宁健康	8,091,320.00	10.85
63	600030	中信证券	7,927,572.00	10.63
64	000333	美的集团	7,904,307.00	10.60
65	688498	源杰科技	7,789,252.38	10.45
66	600183	生益科技	7,778,077.00	10.43
67	688172	燕东微	7,614,842.11	10.22
68	002156	通富微电	7,555,104.00	10.14
69	300017	网宿科技	7,493,578.00	10.05
70	688068	热景生物	7,488,378.42	10.05
71	002353	杰瑞股份	7,378,288.00	9.90
72	688795	摩尔线程	7,313,934.95	9.81
73	300763	锦浪科技	7,213,726.00	9.68
74	600941	中国移动	5,687,942.00	7.63
74	H00941	中国移动	1,476,961.06	1.98
75	600519	贵州茅台	7,119,024.00	9.55
76	688552	航天南湖	7,083,380.30	9.50
77	002465	海格通信	7,046,589.00	9.45
78	300762	上海瀚讯	7,023,166.00	9.42
79	002594	比亚迪	6,944,173.75	9.32
80	688048	长光华芯	6,856,668.61	9.20
81	600150	中国船舶	6,844,713.41	9.18
82	300433	蓝思科技	6,757,235.04	9.06

83	300115	长盈精密	6,720,262.00	9.02
84	300782	卓胜微	6,709,160.40	9.00
85	H01138	中远海能	6,651,330.05	8.92
86	603119	浙江荣泰	6,478,552.69	8.69
87	688037	芯源微	6,368,958.89	8.54
88	688469	芯联集成	6,339,082.32	8.50
89	688311	盟升电子	6,276,804.73	8.42
90	688220	翱捷科技	6,255,404.00	8.39
91	601319	中国人保	6,143,566.00	8.24
92	601857	中国石油	5,083,613.00	6.82
92	H00857	中国石油股份	1,048,029.87	1.41
93	688234	天岳先进	3,214,645.14	4.31
93	H02631	天岳先进	2,904,846.10	3.90
94	688396	华润微	5,998,385.67	8.05
95	603296	华勤技术	5,977,830.00	8.02
96	600259	中稀有色	5,929,001.00	7.95
97	688652	京仪装备	5,912,844.72	7.93
98	000568	泸州老窖	5,810,711.00	7.80
99	688818	电科蓝天	5,698,117.70	7.64
100	301308	江波龙	5,634,231.24	7.56
101	600549	厦门钨业	5,620,176.01	7.54
102	688361	中科飞测	5,599,695.24	7.51
103	601808	中海油服	5,527,365.00	7.41
104	601668	中国建筑	5,500,917.00	7.38
105	000506	招金黄金	5,464,308.00	7.33
106	002463	沪电股份	5,441,617.00	7.30
107	300567	精测电子	5,419,948.00	7.27
108	601988	中国银行	5,352,927.00	7.18
109	601995	中金公司	5,278,247.00	7.08
110	600489	中金黄金	5,208,065.00	6.99
111	002987	京北方	5,200,348.00	6.98
112	H02513	智谱	5,177,287.93	6.95
113	002236	大华股份	5,106,981.00	6.85
114	601898	中煤能源	2,985,929.64	4.01
114	H01898	中煤能源	2,069,894.45	2.78
115	600089	特变电工	5,009,791.00	6.72
116	688258	卓易信息	4,929,076.12	6.61
117	688820	盛合晶微	4,918,233.67	6.60
118	603799	华友钴业	4,889,380.38	6.56
119	688266	泽璟制药	4,877,655.64	6.54
120	601006	大秦铁路	4,877,103.00	6.54
121	002028	思源电气	4,839,951.53	6.49
122	300776	帝尔激光	4,805,291.36	6.45

123	000938	紫光股份	4,790,087.00	6.43
124	H09926	康方生物	4,725,723.97	6.34
125	600919	江苏银行	4,696,616.00	6.30
126	601288	农业银行	4,637,085.00	6.22
127	000807	云铝股份	4,634,952.00	6.22
128	300394	天孚通信	4,587,810.00	6.15
129	300316	晶盛机电	4,573,120.00	6.13
130	600219	南山铝业	4,564,794.00	6.12
131	601328	交通银行	4,523,056.00	6.07
132	688390	固德威	4,460,126.96	5.98
133	601816	京沪高铁	4,459,191.00	5.98
134	000400	许继电气	4,455,641.00	5.98
135	600010	宝钢股份	4,410,000.00	5.92
136	603290	斯达半导	4,405,075.85	5.91
137	300570	太辰光	4,369,887.43	5.86
138	002223	鱼跃医疗	4,365,570.20	5.86
139	000596	古井贡酒	4,349,401.00	5.83
140	601111	中国国航	4,244,486.00	5.69
141	H02228	晶泰控股	4,199,452.36	5.63
142	600887	伊利股份	4,187,846.00	5.62
143	603986	兆易创新	4,141,383.00	5.56
144	600498	烽火通信	4,127,906.03	5.54
145	002980	华盛昌	4,100,655.00	5.50
146	688072	拓荆科技	4,084,830.87	5.48
147	603920	世运电路	3,979,928.70	5.34
148	H02476	胜宏科技	3,921,676.91	5.26
149	600893	航发动力	3,919,874.00	5.26
150	000426	兴业银锡	3,918,072.00	5.26
151	000878	云南铜业	3,820,353.00	5.12
152	603005	晶方科技	3,806,387.20	5.11
153	605598	上海港湾	3,789,551.40	5.08
154	H06869	长飞光纤光缆	3,772,152.39	5.06
155	601216	君正集团	3,734,314.00	5.01
156	002025	航天电器	3,670,038.00	4.92
157	688141	杰华特	3,667,847.57	4.92
158	688123	聚辰股份	3,629,817.20	4.87
159	301526	国际复材	3,566,872.00	4.78
160	H02556	迈富时	3,534,428.20	4.74
161	600711	盛屯矿业	3,509,735.00	4.71
162	002222	福晶科技	3,484,421.00	4.67
163	H09992	泡泡玛特	3,348,822.23	4.49
164	600352	浙江龙盛	3,342,086.00	4.48
165	000988	华工科技	3,285,332.00	4.41

166	000799	酒鬼酒	3,271,814.00	4.39
167	688279	峰岹科技	3,258,711.62	4.37
168	600118	中国卫星	3,254,259.00	4.37
169	300666	江丰电子	3,233,952.00	4.34
170	001979	招商蛇口	3,211,066.94	4.31
171	000725	京东方 A	3,210,300.00	4.31
172	H01208	五矿资源	3,172,506.98	4.26
173	600886	国投电力	3,149,067.00	4.22
174	300418	昆仑万维	3,128,510.00	4.20
175	000738	航发控制	3,078,332.00	4.13
176	920185	贝特瑞	3,064,675.16	4.11
177	300442	润泽科技	3,062,446.59	4.11
178	002422	科伦药业	3,032,806.00	4.07
179	688778	厦钨新能	3,008,375.04	4.04
180	688627	精智达	2,971,943.59	3.99
181	688677	海泰新光	2,953,911.79	3.96
182	600105	永鼎股份	2,948,567.00	3.96
183	688268	华特气体	2,942,605.35	3.95
184	000768	中航西飞	2,942,107.98	3.95
185	601169	北京银行	2,911,096.00	3.91
186	000408	藏格矿业	2,904,980.00	3.90
187	000547	航天发展	2,856,984.00	3.83
188	688372	伟测科技	2,805,994.25	3.76
189	002179	中航光电	2,790,898.00	3.74
190	601100	恒立液压	2,763,762.00	3.71
191	000831	中国稀土	2,762,270.00	3.71
192	002558	巨人网络	2,741,518.00	3.68
193	920045	衡东光	2,729,982.64	3.66
194	603259	药明康德	2,717,746.00	3.65
195	301183	东田微	2,713,807.00	3.64
196	300054	鼎龙股份	2,696,784.00	3.62
197	600153	建发股份	2,664,932.00	3.57
198	000933	神火股份	2,643,085.00	3.55
199	600426	华鲁恒升	2,640,902.00	3.54
200	601567	三星电气	2,635,461.00	3.54
201	688025	杰普特	2,601,860.54	3.49
202	300750	宁德时代	2,577,913.00	3.46
203	000703	恒逸石化	2,520,660.00	3.38
204	H02162	康诺亚－B	2,517,957.19	3.38
205	920438	戈碧迦	2,499,955.18	3.35
206	600673	东阳光	2,499,639.00	3.35
207	300751	迈为股份	2,482,333.00	3.33
208	601138	工业富联	2,477,332.00	3.32

209	688368	晶丰明源	2,411,175.44	3.23
210	601211	国泰海通	2,398,744.00	3.22
211	001389	广合科技	2,354,282.00	3.16
212	600552	凯盛科技	2,328,741.00	3.12
213	002532	天山铝业	2,252,813.00	3.02
214	688416	恒烁股份	2,179,961.42	2.92
215	H00700	腾讯控股	2,177,342.54	2.92
216	300724	捷佳伟创	2,157,492.00	2.89
217	002230	科大讯飞	2,130,858.00	2.86
218	H00670	中国东方航空股份	2,128,444.10	2.86
219	000603	盛达资源	2,116,188.00	2.84
220	688691	灿芯股份	2,079,605.20	2.79
221	600038	中直股份	2,053,343.00	2.75
222	601118	海南橡胶	1,999,554.00	2.68
223	300785	值得买	1,997,261.00	2.68
224	002938	鹏鼎控股	1,996,462.00	2.68
225	H02423	贝壳-W	1,992,644.72	2.67
226	688270	ST 臻镭	1,977,995.59	2.65
227	688120	华海清科	1,896,523.74	2.54
228	601577	长沙银行	1,884,401.00	2.53
229	300454	深信服	1,802,938.00	2.42
230	301556	托普云农	1,796,156.88	2.41
231	300364	中文在线	1,793,338.00	2.41
232	605488	福莱新材	1,783,335.00	2.39
233	002271	东方雨虹	1,757,866.00	2.36
234	603061	金海通	1,748,934.00	2.35
235	000657	中钨高新	1,746,823.00	2.34
236	600185	珠免集团	1,615,233.00	2.17
237	300142	沃森生物	1,598,790.00	2.14
238	300624	万兴科技	1,557,067.00	2.09

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300661	圣邦股份	25,834,419.46	34.66
2	688256	寒武纪	22,148,939.33	29.71
3	600547	山东黄金	20,762,832.00	27.85
3	H01787	山东黄金	1,018,097.60	1.37
4	688195	腾景科技	21,411,336.68	28.72
5	300620	光库科技	20,373,765.70	27.33

6	002281	光迅科技	18,374,928.00	24.65
7	600938	中国海油	10,096,717.93	13.54
7	H00883	中国海洋石油	6,409,112.20	8.60
8	601601	中国太保	15,844,120.00	21.25
9	002475	立讯精密	15,714,737.00	21.08
10	601088	中国神华	15,559,881.00	20.87
11	688008	澜起科技	15,032,421.36	20.17
12	002155	湖南黄金	14,711,589.94	19.74
13	600028	中国石化	13,256,801.00	17.78
14	300502	新易盛	13,080,988.00	17.55
15	688615	合合信息	13,070,339.86	17.53
16	688205	德科立	12,979,564.01	17.41
17	688041	海光信息	12,693,795.31	17.03
18	600256	广汇能源	12,295,474.00	16.49
19	601225	陕西煤业	12,140,464.20	16.29
20	H09988	阿里巴巴-W	12,075,644.24	16.20
21	002142	宁波银行	11,955,097.20	16.04
22	688608	恒玄科技	11,909,382.14	15.98
23	688702	盛科通信	11,883,923.95	15.94
24	601838	成都银行	11,774,082.00	15.79
25	002837	英维克	11,670,459.98	15.66
26	300548	长芯博创	11,603,629.15	15.57
27	688525	佰维存储	11,348,158.38	15.22
28	601318	中国平安	11,173,538.64	14.99
29	600584	长电科技	10,952,962.64	14.69
30	688981	中芯国际	10,946,921.48	14.69
31	688536	思瑞浦	10,671,754.63	14.32
32	688519	南亚新材	10,551,586.73	14.15
33	688385	复旦微电	8,627,934.34	11.57
33	H01385	上海复旦	1,852,340.63	2.48
34	002384	东山精密	10,105,718.00	13.56
35	688777	中控技术	10,100,293.84	13.55
36	600048	保利发展	10,082,409.00	13.53
37	601398	工商银行	10,067,962.00	13.51
38	600362	江西铜业	8,012,969.00	10.75
38	H00358	江西铜业股份	1,642,249.36	2.20
39	002916	深南电路	9,367,191.00	12.57
40	H01024	快手-W	9,291,382.32	12.46
41	300059	东方财富	9,050,014.00	12.14
42	688802	沐曦股份	9,024,890.00	12.11
43	H01347	华虹宏力	8,947,153.90	12.00
44	601077	渝农商行	8,833,252.72	11.85
45	600183	生益科技	8,766,494.00	11.76

46	300017	网宿科技	8,373,747.98	11.23
47	000830	鲁西化工	8,241,681.00	11.06
48	603119	浙江荣泰	8,221,440.00	11.03
49	688172	燕东微	8,145,203.64	10.93
50	601336	新华保险	8,052,246.00	10.80
51	603993	洛阳钼业	5,071,035.00	6.80
51	H03993	洛阳钼业	2,965,437.01	3.98
52	300782	卓胜微	7,985,670.00	10.71
53	000333	美的集团	7,968,613.00	10.69
54	688220	翱捷科技	7,901,081.96	10.60
55	601728	中国电信	7,875,582.00	10.57
56	601998	中信银行	7,831,989.00	10.51
57	601919	中远海控	5,129,382.30	6.88
57	H01919	中远海控	2,643,163.75	3.55
58	601628	中国人寿	7,687,984.08	10.31
59	688766	普冉股份	7,678,096.65	10.30
60	688498	源杰科技	7,578,813.40	10.17
61	300115	长盈精密	7,471,719.00	10.02
62	002156	通富微电	7,440,798.00	9.98
63	300763	锦浪科技	7,324,895.96	9.83
64	300253	卫宁健康	7,182,157.92	9.63
65	600941	中国移动	5,609,535.00	7.53
65	H00941	中国移动	1,465,954.58	1.97
66	688552	航天南湖	7,064,691.65	9.48
67	600519	贵州茅台	6,955,160.35	9.33
68	688507	索辰科技	6,934,653.17	9.30
69	002353	杰瑞股份	6,915,393.00	9.28
70	300762	上海瀚讯	6,824,008.00	9.15
71	H01138	中远海能	6,749,557.75	9.05
72	002594	比亚迪	6,727,373.00	9.02
73	002465	海格通信	6,645,460.00	8.91
74	688037	芯源微	6,606,302.92	8.86
75	688795	摩尔线程	6,453,467.08	8.66
76	600150	中国船舶	6,424,192.11	8.62
77	002987	京北方	6,197,172.21	8.31
78	688048	长光华芯	6,196,065.16	8.31
79	688311	盟升电子	6,106,934.74	8.19
80	603296	华勤技术	6,059,922.00	8.13
81	H02228	晶泰控股	5,975,145.69	8.02
82	688192	迪哲医药	5,908,313.12	7.93
83	600259	中稀有色	5,907,675.00	7.93
84	H02631	天岳先进	2,990,397.32	4.01
84	688234	天岳先进	2,699,753.84	3.62

85	601857	中国石油	4,733,461.00	6.35
85	H00857	中国石油股份	947,857.26	1.27
86	688068	热景生物	5,678,700.74	7.62
87	002463	沪电股份	5,644,284.00	7.57
88	000878	云南铜业	5,623,622.00	7.54
89	002236	大华股份	5,613,358.06	7.53
90	688818	电科蓝天	5,517,451.69	7.40
91	600900	长江电力	5,517,381.00	7.40
92	601319	中国人保	5,470,940.44	7.34
93	601668	中国建筑	5,421,567.00	7.27
94	000568	泸州老窖	5,190,923.00	6.96
95	301308	江波龙	5,175,904.91	6.94
96	000938	紫光股份	4,997,301.00	6.70
97	601898	中煤能源	2,751,570.36	3.69
97	H01898	中煤能源	2,117,285.69	2.84
98	600489	中金黄金	4,842,778.00	6.50
99	688266	泽璟制药	4,814,130.55	6.46
100	688072	拓荆科技	4,738,344.19	6.36
101	300394	天孚通信	4,732,822.00	6.35
102	601808	中海油服	4,730,963.00	6.35
103	688012	中微公司	4,719,342.04	6.33
104	600919	江苏银行	4,718,634.00	6.33
105	600219	南山铝业	4,557,319.00	6.11
106	688820	盛合晶微	4,522,036.12	6.07
107	688258	卓易信息	4,493,958.24	6.03
108	000807	云铝股份	4,448,093.00	5.97
109	603799	华友钴业	4,440,185.00	5.96
110	600089	特变电工	4,420,655.00	5.93
111	000506	招金黄金	4,410,145.00	5.92
112	601816	京沪高铁	4,385,819.00	5.88
113	300570	太辰光	4,382,835.00	5.88
114	002025	航天电器	4,379,499.00	5.88
115	002028	思源电气	4,377,793.00	5.87
116	600549	厦门钨业	4,361,389.48	5.85
117	600893	航发动力	4,326,585.00	5.80
118	002980	华盛昌	4,289,293.20	5.75
119	603290	斯达半导	4,285,597.00	5.75
120	600010	宝钢股份	4,239,980.00	5.69
121	601111	中国国航	4,234,972.76	5.68
122	H00700	腾讯控股	4,223,784.23	5.67
123	688390	固德威	4,222,796.66	5.66
124	002415	海康威视	4,191,517.12	5.62
125	300433	蓝思科技	4,164,462.00	5.59

126	600887	伊利股份	4,126,861.48	5.54
127	600498	烽火通信	4,108,631.14	5.51
128	601166	兴业银行	4,102,829.00	5.50
129	601100	恒立液压	4,045,195.71	5.43
130	300316	晶盛机电	4,041,137.00	5.42
131	000596	古井贡酒	3,978,152.00	5.34
132	H09926	康方生物	3,962,240.84	5.32
133	920045	衡东光	3,943,869.27	5.29
134	002223	鱼跃医疗	3,891,389.00	5.22
135	000400	许继电气	3,887,499.00	5.22
136	688018	乐鑫科技	3,825,225.86	5.13
137	603920	世运电路	3,780,610.00	5.07
138	000426	兴业银锡	3,666,828.72	4.92
139	301526	国际复材	3,584,511.00	4.81
140	600352	浙江龙盛	3,528,285.00	4.73
141	688677	海泰新光	3,495,362.58	4.69
142	H01208	五矿资源	3,480,086.30	4.67
143	603986	兆易创新	3,431,665.00	4.60
144	000988	华工科技	3,409,710.00	4.57
145	600886	国投电力	3,407,909.00	4.57
146	688123	聚辰股份	3,400,232.07	4.56
147	688052	纳芯微	3,366,270.93	4.52
148	688141	杰华特	3,286,486.48	4.41
149	300666	江丰电子	3,283,746.00	4.41
150	600711	盛屯矿业	3,282,796.00	4.40
151	688778	厦钨新能	3,214,849.15	4.31
152	600118	中国卫星	3,201,480.00	4.29
153	300442	润泽科技	3,191,614.00	4.28
154	603005	晶方科技	3,173,844.00	4.26
155	000738	航发控制	3,141,346.00	4.21
156	000831	中国稀土	3,107,772.00	4.17
157	H02556	迈富时	3,093,486.05	4.15
158	920185	贝特瑞	3,085,693.84	4.14
159	300418	昆仑万维	3,066,322.00	4.11
160	600673	东阳光	3,010,025.00	4.04
161	H02476	胜宏科技	2,999,829.39	4.02
162	000768	中航西飞	2,953,364.00	3.96
163	000408	藏格矿业	2,929,324.00	3.93
164	688279	峰岬科技	2,924,955.99	3.92
165	002222	福晶科技	2,901,484.00	3.89
166	000799	酒鬼酒	2,885,790.67	3.87
167	H06869	长飞光纤光缆	2,885,738.39	3.87
168	002179	中航光电	2,830,177.00	3.80

169	H02162	康诺亚一 B	2,813,985.13	3.77
170	688627	精智达	2,809,408.84	3.77
171	002648	卫星化学	2,770,586.00	3.72
172	301183	东田微	2,762,942.00	3.71
173	002422	科伦药业	2,742,148.00	3.68
174	601169	北京银行	2,701,145.00	3.62
175	300750	宁德时代	2,681,522.00	3.60
176	600105	永鼎股份	2,658,315.00	3.57
177	688268	华特气体	2,646,455.95	3.55
178	000933	神火股份	2,641,239.00	3.54
179	688025	杰普特	2,622,036.78	3.52
180	H00902	华能国际电力股份	2,607,938.76	3.50
181	002558	巨人网络	2,598,657.00	3.49
182	920438	戈碧迦	2,591,587.02	3.48
183	600153	建发股份	2,587,382.00	3.47
184	300054	鼎龙股份	2,575,045.00	3.45
185	001979	招商蛇口	2,573,417.00	3.45
186	000703	恒逸石化	2,560,032.32	3.43
187	001389	广合科技	2,521,935.00	3.38
188	605598	上海港湾	2,504,447.00	3.36
189	603259	药明康德	2,490,326.00	3.34
190	688416	恒烁股份	2,488,629.33	3.34
191	688372	伟测科技	2,481,816.73	3.33
192	600426	华鲁恒升	2,473,018.00	3.32
193	601567	三星电气	2,401,256.70	3.22
194	688368	晶丰明源	2,328,940.23	3.12
195	688332	中科蓝讯	2,245,767.82	3.01
196	603171	税友股份	2,242,092.00	3.01
197	000657	中钨高新	2,196,448.00	2.95
198	601138	工业富联	2,184,493.00	2.93
199	688270	ST 臻镭	2,175,500.05	2.92
200	300751	迈为股份	2,169,407.00	2.91
201	002532	天山铝业	2,135,494.00	2.86
202	300624	万兴科技	2,090,647.00	2.80
203	688120	华海清科	2,066,939.03	2.77
204	601600	中国铝业	2,057,720.00	2.76
205	688200	华峰测控	2,040,250.67	2.74
206	H00670	中国东方航空股份	2,009,470.31	2.70
207	002230	科大讯飞	1,961,973.00	2.63
208	000547	航天发展	1,939,979.00	2.60
209	300785	值得买	1,916,727.00	2.57

210	688691	灿芯股份	1,910,249.79	2.56
211	601577	长沙银行	1,869,140.00	2.51
212	600038	中直股份	1,843,531.00	2.47
213	002271	东方雨虹	1,841,220.00	2.47
214	601118	海南橡胶	1,838,935.62	2.47
215	002938	鹏鼎控股	1,830,956.00	2.46
216	000603	盛达资源	1,813,602.00	2.43
217	300364	中文在线	1,808,282.00	2.43
218	300724	捷佳伟创	1,743,718.00	2.34
219	300454	深信服	1,699,112.00	2.28
220	H02423	贝壳-W	1,662,401.28	2.23
221	688396	华润微	1,636,004.31	2.19
222	301556	托普云农	1,625,510.00	2.18
223	688361	中科飞测	1,620,852.35	2.17
224	000725	京东方 A	1,595,712.00	2.14
225	300339	润和软件	1,560,993.00	2.09
226	605488	福莱新材	1,560,835.00	2.09
227	300124	汇川技术	1,552,538.00	2.08
228	301236	软通动力	1,546,326.00	2.07
229	603009	北特科技	1,518,372.00	2.04
230	688088	虹软科技	1,506,397.75	2.02

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,523,740,044.32
卖出股票收入（成交）总额	1,370,837,387.31

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	12,759,081.04	5.42
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	12,759,081.04	5.42
----	----	---------------	------

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	019785	25 国债 13	126,000	12,759,081.04	5.42

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行宁波市分行处罚的情况。

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。

7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 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	209,521.63
2	应收清算款	1,731,539.73
3	应收股利	106,303.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,271.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,055,636.06

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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
创金合信弘科混合发起A	1,342	140,137.76	8,714,176.53	4.63%	179,350,694.31	95.37%
创金合信弘	234	108,289.82	5,001,050.0	19.74%	20,338,768.	80.26%

科混合发起 C			0		11	
合计	1,553	137,414.48	13,715,226.53	6.43%	199,689,462.42	93.57%

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 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	创金合信弘科混合发起 A	297,428.22	0.16%
	创金合信弘科混合发起 C	718,345.09	2.83%
	合计	1,015,773.31	0.48%

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）。

8.3 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	创金合信弘科混合发起 A	0
	创金合信弘科混合发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信弘科混合发起 A	10~50
	创金合信弘科混合发起 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,100.21	4.69	10,002,100.21	4.69	36 个月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	296,579.19	0.14	296,579.19	0.14	36 个月
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,298,679.40	4.83	10,298,679.40	4.83	36 个月

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信弘科混合发起 A	创金合信弘科混合发起 C
基金合同生效日(2025 年 12 月 2 日)基金份额总额	45,988,548.81	25,439,299.30
本报告期期初基金份额总额	45,988,548.81	25,439,299.30
本报告期基金总申购份额	210,335,161.31	15,568,466.01
减：本报告期基金总赎回份额	68,258,839.28	15,667,947.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	188,064,870.84	25,339,818.11

§ 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
国联民生证券	2	1,429,310,662.90	49.39%	651,618.62	49.50%	-
第一创业证券	4	578,359,788.37	19.98%	263,212.09	19.99%	-
东北证券	2	479,740,416.63	16.58%	233,419.69	17.73%	-
长江证券	2	211,503,510.31	7.31%	96,424.48	7.32%	-
中泰证券	1	143,622,017.20	4.96%	48,242.86	3.66%	-
中信建投证券	2	51,611,071.25	1.78%	23,529.16	1.79%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	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比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国联民生证券	11,106,133.00	82.84%	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	1,100,176.00	8.21%	-	-	-	-
长江证券	1,200,204.00	8.95%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金开放日常申购、转换转入、定期定额投资业务的公	公司官网、上海证券报、中国证监会基金	2026-01-24

	告	电子披露网站	
2	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27
3	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金 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
4	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-25
5	创金合信弘科混合型发起式证券投资基金（C 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

§ 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

本基金本报告期未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信弘科混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信弘科混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信弘科混合型发起式证券投资基金 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