

创金合信均益量化选股混合型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52

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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信均益量化选股混合	
基金主代码	020224	
交易代码	020224	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,689,762.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	020224	020225
报告期末下属分级基金的份额总额	25,179,084.83 份	7,510,677.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股策略，在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。 2、股票投资策略 （1）A 股投资策略 1) 行业配置策略 本基金将采用定量与定性相结合的方法，构建有逻辑支撑和数据验证的行业配置策略。定性分析方面，根据中国经济增长的阶段和周期特征，结合国家产业政策和区域发展政策，分析细分行业的发展前景、行业竞争结构和行业盈利模式等，评估各行业的投资价值。定量分析方面，从景气度角度对各行业进行横向比较，选择基本面稳定、盈利能力强、处于相对高速增长阶段的行业，把握趋势性投资机会，同时从估值和交易拥挤度的角度对估值严重透支、交易过热的行业进行规避。 2) 个股投资策略 本基金将通过定量与定性相结合的分析方法进行个股投资。定性分析方面，择优精选出符合行业发展方向，基本面优秀、成长性好、估值合理等具有良好预期收益的 A 股上市公司股票。定量分析方面，本基金以国

	际通用的多因子模型为基础框架筛选 A 股上市公司股票，根据国内资本市场的特点和大量历史数据的实证检验，结合基金管理人量化团队多年定量研究与投资的经验，充分挖掘持续稳健的超额收益因子，精选并持有预期收益较好的股票构成投资组合。本基金所采用的多因子模型主要包括基本面因子、分析师因子、价量因子、事件因子等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。 ①基本面因子 基本面因子指个股估值、盈利能力、盈利质量等方面的财务信息，代表公司的经营能力。主要包括以下指标：市盈率、市净率、营业收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、销售毛利率等。 ②分析师因子 分析师因子指证券分析师对个股财务数据的预测信息，代表其对公司未来前景的判断。主要包括以下指标：一致预期营业收入增长率、一致预期净利润增长率、一致预期净资产收益率等。 ③价量因子 价量因子指个股的市场行情信息，主要包括以下指标：历史收益率、历史换手率等。 ④事件因子 事件因子指个股的公告、新闻等信息，主要包括以下指标：大股东增持事件、并购重组事件、机构调研事件等。 （2）港股通标的股票投资策略 本基金将通过定量与定性相结合的分析方法进行港股投资。定性分析方面，择优精选出符合行业发展方向，基本面优秀、成长性好、估值合理等具有良好预期收益的港股通标的公司股票。定量分析方面，根据香港证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合香港市场的因子组合，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。 （3）投资组合优化模型 在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，分别根据 A 股和港股通多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化，构建风险调整后的最优投资组合。 （4）存托凭证的投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述上市境内交易的股票投资策略执行。 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/交易策略 （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	$\text{中证全指指数收益率} \times 75\% + \text{中证港股通综合指数收益率(经汇率调整后)} \times 5\% + \text{人民币活期存款利率(税后)} \times 20\%$
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金除可投资 A 股外，还可通过港股通机制投资港股通标的的股票，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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	0755-25832571	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518052	200336
法定代表人	青美平措	任德奇

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	中国证券报
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、创金合信均益量化选股混合 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	3,076,211.71
本期利润	2,714,667.64
加权平均基金份额本期利润	0.0795
本期加权平均净值利润率	5.89%
本期基金份额净值增长率	0.79%
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	7,677,390.87
期末可供分配基金份额利润	0.3049
期末基金资产净值	32,856,475.70
期末基金份额净值	1.3049
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	30.49%

2、创金合信均益量化选股混合 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	2,163,177.85
本期利润	55,782.08
加权平均基金份额本期利润	0.0036
本期加权平均净值利润率	0.27%
本期基金份额净值增长率	0.54%
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	2,191,078.77
期末可供分配基金份额利润	0.2917
期末基金资产净值	9,701,756.50
期末基金份额净值	1.2917
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	29.17%

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

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信均益量化选股混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	1.09%	8.60%	1.06%	-8.23%	0.03%
过去六个月	0.79%	1.14%	7.30%	1.03%	-6.51%	0.11%
过去一年	11.42%	0.99%	23.27%	0.90%	-11.85%	0.09%
自基金合同 生效起至今	30.49%	1.23%	45.29%	1.09%	-14.80%	0.14%

创金合信均益量化选股混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.25%	1.09%	8.60%	1.06%	-8.35%	0.03%
过去六个月	0.54%	1.14%	7.30%	1.03%	-6.76%	0.11%
过去一年	10.86%	0.99%	23.27%	0.90%	-12.41%	0.09%
自基金合同 生效起至今	29.17%	1.23%	45.29%	1.09%	-16.12%	0.14%

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

创金合信均益量化选股混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年06月27日-2026年06月30日)



创金合信均益量化选股混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年06月27日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例

为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董梁	本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人	2024 年 6 月 27 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。
孙悦	本基金基金经理	2024 年 6 月 27 日	-	8	孙悦先生，中国国籍，北京大学硕士。2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理、兼任投资经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

1、截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

2、本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，孙悦离任产品情况如下：

产品类型:私募资产管理计划，离任数量:2 只，离任时间:2026-02-11、2026-03-26。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，宏观主线由一季度地缘风险冲击转向二季度政策分化与基本面验证。一季度，中东冲突推升能源价格与滞胀风险，美联储按兵不动，降息预期下降；国内政策前置发力，“两新”“两重”资金集中投放，两会审议通过“十五五”规划纲要。二季度，美国关税冲击显性化，通胀粘性依旧，中东局势未根本缓和但能源价格冲高后企稳；国内资金进入效果验证期，生产端景气度高位回落，消费修复放缓，地产边际企稳，新质生产力支持政策密集出台，市场博弈焦点转向下半年增量政策空间与海外需求变化。大类资产方面，原油冲高回落，黄金先涨后跌，美元指数小幅上行，美股先跌后涨。A 股一季度先扬后抑、风格轮动明显，二季度在科技引领下有所上涨。

均益量化选股基金，是一只采用主动量化选股策略的基金，以多策略配置的形式进行投资。经济具有周期性，市场风格也具有周期性，不同风格、行业的单一策略在不同市场环境中表现差异巨大，造成投资组合波动性较大。采用多个长期有效、同时低相关的策略进行配置投资，可以显著降低组合整体的波动，提高组合对不同环境的适应能力。对于股票来说，估值和成长性是最重要的考量因素，对于投资策略来说，同时兼顾价值与成长两种风格，是应对未来市场变化的有效策略。产品运作层面，采用多策略+组合优化的模式，

在保持对于基准指数较小偏离的同时，对各策略进行积极配置，力争获得可持续的超额收益。

目前投资策略以成长策略和深度学习策略为主，深度学习策略上半年的表现对产品净值造成影响。在后市中，会根据市场变化调整各类策略的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信均益量化选股混合 A 基金份额净值为 1.3049 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 7.30%；截至本报告期末创金合信均益量化选股混合 C 基金份额净值为 1.2917 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为 7.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，海外方面，美国经济仍具韧性，但通胀粘性叠加能源价格扰动，美联储上半年维持利率不变，降息预期转为推迟甚至不排除加息可能，新任主席沃什主导沟通改革后政策路径更依赖数据。国内方面，“十五五”开局之年稳中有进，上半年 GDP 同比增长 4.7%，新质生产力加速成为核心引擎。经济政策方面，存量财政政策加快落地见效，货币政策维持适度宽松但更注重精准滴灌，下半年政策节奏将从前期“审慎克制”转向“加力落地”。

股市方面，上半年科技股“一枝独秀”，赚钱效应高度集中。展望下半年，市场风格有望从极致分化走向更加均衡。经历了上半年的估值大幅扩张后，科技板块需时间消化涨幅，而传统板块在估值风险释放后，若内需修复信号持续强化，与宏观经济关联度较高的领域或迎来阶段性估值修复机会。成长与价值、科技与传统之间的再平衡，可能成为下半年的重要特征。长期来看，若中东局势不再超预期恶化、美联储政策路径逐步明朗，市场结构性机会依然存在，但需警惕通胀扰动及局部交易拥挤带来的波动加剧风险。

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

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千元的情形，该情形发生的时间范围为 2026 年 5 月 21 日起并延续至报告期末。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在创金合信均益量化选股混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，创金合信基金管理有限公司在创金合信均益量化选股混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由创金合信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关创金合信均益量化选股混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
----	-----	---------------------	-----------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,931,096.79	4,763,950.99
结算备付金		1,032.72	1,646,284.33
存出保证金		1,692,665.06	10,510,778.14
交易性金融资产	6.4.7.2	37,080,299.12	93,261,368.46
其中：股票投资		37,080,299.12	93,261,368.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	-
应收股利		26,307.47	-
应收申购款		980,252.61	8,880.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		42,711,653.77	110,191,262.80
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		38,039.76	35,018.91
应付管理人报酬		43,912.25	116,257.59
应付托管费		7,318.74	19,376.28
应付销售服务费		4,084.82	14,757.28
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	6.4.7.6	60,066.00	158,057.89
负债合计		153,421.57	343,467.95

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,689,762.56	85,045,649.18
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	9,868,469.64	24,802,145.67
净资产合计		42,558,232.20	109,847,794.85
负债和净资产总计		42,711,653.77	110,191,262.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，创金合信均益量化选股混合 A 份额净值 1.3049 元，基金份额总额 25,179,084.83 份；创金合信均益量化选股混合 C 份额净值 1.2917 元，基金份额总额 7,510,677.73 份；总份额合计 32,689,762.56 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,352,626.54	7,631,891.45
1.利息收入		15,141.19	30,633.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,141.19	30,633.93
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）		5,583,707.13	3,292,412.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,198,302.45	1,236,265.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	385,404.68	2,056,146.55
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	6.4.7.17	-2,468,939.84	4,079,304.24

失以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	222,718.06	229,540.92
减: 二、营业总支出		582,176.82	1,322,002.50
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	402,550.32	969,827.97
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	67,091.79	161,637.99
3.销售服务费	6.4.10.2.3	52,989.35	112,185.26
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	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.21	59,545.36	78,351.28
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,770,449.72	6,309,888.95
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,770,449.72	6,309,888.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,770,449.72	6,309,888.95

6.3 净资产变动表

会计主体: 创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

本报告期: 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	85,045,649.18	-	24,802,145.67	109,847,794.85
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,045,649.18	-	24,802,145.67	109,847,794.85
三、本期增减变	-52,355,886.62	-	-14,933,676.03	-67,289,562.65

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	2,770,449.72	2,770,449.72
（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）	-52,355,886.62	-	-17,704,125.75	-70,060,012.37
其中：1.基金申购款	23,488,067.69	-	7,904,807.31	31,392,875.00
2.基金赎回款	-75,843,954.31	-	-25,608,933.06	-101,452,887.37
（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	32,689,762.56	-	9,868,469.64	42,558,232.20
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	154,987,192.05	-	19,608,136.46	174,595,328.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	154,987,192.05	-	19,608,136.46	174,595,328.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,793,852.52	-	1,452,458.21	-29,341,394.31
（一）、综合收益总额	-	-	6,309,888.95	6,309,888.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-30,793,852.52	-	-4,857,430.74	-35,651,283.26

“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	48,530,169.41	-	6,168,002.66	54,698,172.07
2.基金赎回款	-79,324,021.93	-	-11,025,433.40	-90,349,455.33
(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	124,193,339.53	-	21,060,594.67	145,253,934.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____ ____奚胜田____ ____吉祥____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信均益量化选股混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2023 年 11 月 21 日证监许可[2023]2655 号文《关于准予创金合信均益量化选股混合型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2024 年 6 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 238,324,294.95 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

本基金于 2024 年 5 月 20 日至 2024 年 6 月 25 日募集，募集期间净认购资金人民币 238,228,208.50 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 96,086.45 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 238,324,294.95 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 2400118 号验资报告。

根据《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费，但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额;不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服

务费的基金份额类别为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下： T 日某类基金份额的基金份额净值= T 日该类基金份额的基金资产净值/ T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率 $\times$ 75%+中证港股通综合指数收益率（经汇率调整后） $\times$ 5%+人民币活期存款利率（税后） $\times$ 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,931,096.79
等于：本金	2,930,811.89
加：应计利息	284.90
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	2,931,096.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	38,799,861.08	-	37,080,299.12	-1,719,561.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,799,861.08	-	37,080,299.12	-1,719,561.96

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,545.36
其他应付	520.64
合计	60,066.00

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信均益量化选股混合 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	58,589,687.76	58,589,687.76
本期申购	22,840,094.52	22,840,094.52
本期赎回（以“-”号填列）	-56,250,697.45	-56,250,697.45
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	25,179,084.83	25,179,084.83

创金合信均益量化选股混合 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	26,455,961.42	26,455,961.42
本期申购	647,973.17	647,973.17
本期赎回（以“-”号填列）	-19,593,256.86	-19,593,256.86
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	7,510,677.73	7,510,677.73

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信均益量化选股混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,994,432.24	-4,727,607.17	17,266,825.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,994,432.24	-4,727,607.17	17,266,825.07
本期利润	3,076,211.71	-361,544.07	2,714,667.64
本期基金份额交易产生的变动数	-13,557,239.79	1,253,137.95	-12,304,101.84
其中：基金申购款	10,337,367.72	-2,655,218.26	7,682,149.46
基金赎回款	-23,894,607.51	3,908,356.21	-19,986,251.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,513,404.16	-3,836,013.29	7,677,390.87

创金合信均益量化选股混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,657,925.11	-2,122,604.51	7,535,320.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,657,925.11	-2,122,604.51	7,535,320.60
本期利润	2,163,177.85	-2,107,395.77	55,782.08
本期基金份额交易产生的变动数	-8,494,221.40	3,094,197.49	-5,400,023.91
其中：基金申购款	277,534.70	-54,876.85	222,657.85
基金赎回款	-8,771,756.10	3,149,074.34	-5,622,681.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,326,881.56	-1,135,802.79	2,191,078.77

6.4.7.9 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	5,737.04
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	3,807.52
其他	5,596.63
合计	15,141.19

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 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	5,198,302.45
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	5,198,302.45

6.4.7.10.2 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	405,795,731.27
减：卖出股票成本总额	399,910,632.59
减：交易费用	686,796.23
买卖股票差价收入	5,198,302.45

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 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	385,404.68
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	385,404.68

6.4.7.17 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	-2,468,939.84
——股票投资	-2,468,939.84
——债券投资	-
——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	-2,468,939.84

6.4.7.18 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	221,911.61
转换费收入	806.45
合计	222,718.06

6.4.7.19 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 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	12,574.99
信息披露费	46,970.37
证券出借违约金	-
合计	59,545.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	402,550.32	969,827.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	197,137.49	477,613.15
应支付基金管理人的净管理费	205,412.83	492,214.82

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	67,091.79	161,637.99

注：支付基金托管人交通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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C	合计
创金合信直销	-	108.51	108.51
第一创业证券	-	19.61	19.61
交通银行	-	20,447.37	20,447.37
合计	-	20,575.49	20,575.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C	合计
创金合信直销	-	110.07	110.07
第一创业证券	-	-	-
交通银行	-	48,138.60	48,138.60
合计	-	48,248.67	48,248.67

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 0.5%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 × 0.5% / 当年天数。

销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	2,931,096.79	5,737.04	8,297,904.12	8,030.39

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	92.18	463.15	26	2,396.68	12,041.90	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	1-6 个月（含）	新股锁定	11.18	17.59	97	1,084.46	1,706.23	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	1-6 个月（含）	新股锁定	21.88	25.52	38	831.44	969.76	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	400	181,537.23	351,812.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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交通银行股份有限公司，因而与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主动投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状

况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,931,096.79	-	-	-	2,931,096.79
结算备付金	1,032.72	-	-	-	1,032.72
存出保证金	1,692,665.06	-	-	-	1,692,665.06
交易性金融资产	-	-	-	37,080,299.12	37,080,299.12
应收股利	-	-	-	26,307.47	26,307.47
应收申购款	-	-	-	980,252.61	980,252.61
资产总计	4,624,794.57	-	-	38,086,859.20	42,711,653.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	38,039.76	38,039.76
应付管理人报酬	-	-	-	43,912.25	43,912.25

应付托管费	-	-	-	7,318.74	7,318.74
应付销售服务费	-	-	-	4,084.82	4,084.82
其他负债	-	-	-	60,066.00	60,066.00
负债总计	-	-	-	153,421.57	153,421.57
利率敏感度缺口	4,624,794.57	-	-	37,933,437.63	42,558,232.20
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	4,763,950.99	-	-	-	4,763,950.99
结算备付金	1,646,284.33	-	-	-	1,646,284.33
存出保证金	10,510,778.14	-	-	-	10,510,778.14
交易性金融资产	-	-	-	93,261,368.46	93,261,368.46
应收申购款	-	-	-	8,880.88	8,880.88
资产总计	16,921,013.46	-	-	93,270,249.34	110,191,262.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,018.91	35,018.91
应付管理人报酬	-	-	-	116,257.59	116,257.59
应付托管费	-	-	-	19,376.28	19,376.28
应付销售服务费	-	-	-	14,757.28	14,757.28
其他负债	-	-	-	158,057.89	158,057.89
负债总计	-	-	-	343,467.95	343,467.95
利率敏感度缺口	16,921,013.46	-	-	92,926,781.39	109,847,794.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.2.1 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	-	2,703,774.45	-	-	-	2,703,774.45
应收股利	-	26,307.47	-	-	-	26,307.47
资产合计	-	2,730,081.92	-	-	-	2,730,081.92
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	-	2,730,081.92	-	-	-	2,730,081.92

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	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 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%	136,504.10 -

	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-136,504.10	-
--	-------------------	-------------	---

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	37,080,299.12	87.13	93,261,368.46	84.90
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	37,080,299.12	87.13	93,261,368.46	84.90

6.4.13.4.3.2 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%	1,919,647.09	4,327,327.50
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,919,647.09	-4,327,327.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	36,713,769.23
第二层次	351,812.00
第三层次	14,717.89
合计	37,080,299.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,080,299.12	86.82
	其中：股票	37,080,299.12	86.82
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	2,932,129.51	6.86
8	其他各项资产	2,699,225.14	6.32
9	合计	42,711,653.77	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 2,703,774.45 元，占净值比为 6.35%。

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	132,825.00	0.31
B	采矿业	1,682,418.00	3.95
C	制造业	23,936,955.07	56.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	375,046.00	0.88
E	建筑业	580,326.00	1.36
F	批发和零售业	565,841.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,557,915.40	3.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,795,830.00	4.22
J	金融业	1,455,345.40	3.42
K	房地产业	399,679.00	0.94
L	租赁和商务服务业	465,280.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	612,371.80	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	187,681.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	129,984.00	0.31
Q	卫生和社会工作	133,980.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	281,307.00	0.66
S	综合	83,740.00	0.20
	合计	34,376,524.67	80.78

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（%）
原材料	254,467.78	0.60
日常消费品	137,647.80	0.32
能源	134,364.69	0.32
金融	154,150.25	0.36
医疗保健	495,525.15	1.16
工业	563,701.98	1.32
信息技术	404,257.92	0.95
通讯业务	139,141.71	0.33
公用事业	277,519.10	0.65
房地产	142,998.07	0.34
合计	2,703,774.45	6.35

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	300037	新宙邦	4,600	427,110.00	1.00
2	300750	宁德时代	1,000	393,010.00	0.92
3	688536	思瑞浦	1,000	364,090.00	0.86
4	605117	德业股份	3,380	358,888.40	0.84
5	688072	拓荆科技	400	351,812.00	0.83
6	600233	圆通速递	19,700	310,275.00	0.73
7	688127	蓝特光学	3,000	292,800.00	0.69
8	688362	甬矽电子	3,000	289,200.00	0.68
9	688378	奥来德	4,600	285,200.00	0.67
10	300953	震裕科技	2,120	283,444.00	0.67
11	300124	汇川技术	4,200	278,586.00	0.65
12	000807	云铝股份	12,400	274,536.00	0.65
13	600281	华阳新材	66,800	273,880.00	0.64
14	688392	骄成超声	1,200	272,616.00	0.64
15	300570	太辰光	1,100	271,381.00	0.64
16	300394	天孚通信	880	266,358.40	0.63

17	600988	赤峰黄金	10,100	265,832.00	0.62
18	601916	浙商银行	98,600	259,318.00	0.61
19	300155	安居宝	64,800	254,016.00	0.60
20	002682	龙洲股份	59,500	252,280.00	0.59
21	002998	优彩资源	38,000	247,380.00	0.58
22	603929	亚翔集成	900	244,818.00	0.58
23	002531	天顺风能	29,000	244,470.00	0.57
24	002652	扬子新材	55,900	238,134.00	0.56
25	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.56
26	300919	中伟新材	5,400	236,250.00	0.56
27	002544	普天科技	12,300	224,106.00	0.53
28	600299	安迪苏	27,600	216,660.00	0.51
29	688002	睿创微纳	1,400	216,566.00	0.51
30	301136	招标股份	19,700	216,306.00	0.51
31	688048	长光华芯	400	200,800.00	0.47
32	603993	洛阳钼业	11,300	198,315.00	0.47
33	300870	欧陆通	560	193,586.40	0.45
34	002250	联化科技	14,100	192,747.00	0.45
35	001309	德明利	200	188,580.00	0.44
36	688025	杰普特	400	188,000.00	0.44
37	300592	华凯易佰	10,400	184,080.00	0.43
38	688409	富创精密	600	183,750.00	0.43
39	601677	明泰铝业	11,000	182,600.00	0.43
40	002371	北方华创	200	176,912.00	0.42
41	600883	博闻科技	25,100	175,700.00	0.41
42	300405	科隆股份	33,800	175,084.00	0.41
43	603168	莎普爱思	36,900	174,168.00	0.41
44	000333	美的集团	2,300	173,719.00	0.41
45	601168	西部矿业	6,400	173,696.00	0.41
46	H02359	药明康德	1,300	173,544.98	0.41
47	301629	矽电股份	400	172,160.00	0.40
48	002179	中航光电	3,700	170,940.00	0.40
49	000017	深中华 A	27,600	168,912.00	0.40
50	H00669	创科实业	1,500	168,715.84	0.40
51	600176	中国巨石	2,300	167,624.00	0.39
52	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.39
53	688387	信科移动	8,400	166,656.00	0.39
54	688248	南网科技	2,400	166,032.00	0.39
55	H06869	长飞光纤光 缆	500	110,913.84	0.26
55	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.13
56	600774	汉商集团	26,300	164,638.00	0.39
57	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.38

58	603703	盛洋科技	14,600	162,060.00	0.38
59	H09995	荣昌生物	2,500	161,333.16	0.38
60	H06821	凯莱英	1,700	160,647.01	0.38
61	688667	菱电电控	1,200	160,380.00	0.38
62	601899	紫金矿业	6,300	158,382.00	0.37
63	301235	华康洁净	2,100	157,521.00	0.37
64	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.37
65	603321	梅轮电梯	27,200	155,584.00	0.37
66	000100	TCL 科技	26,700	155,394.00	0.37
67	H00981	中芯国际	2,000	155,296.74	0.36
68	H00005	汇丰控股	1,200	154,150.25	0.36
69	301025	读客文化	19,700	152,872.00	0.36
70	002120	韵达股份	23,600	150,096.00	0.35
71	002558	巨人网络	5,400	148,824.00	0.35
72	600150	中国船舶	4,400	148,676.00	0.35
73	300054	鼎龙股份	1,400	148,358.00	0.35
74	000426	兴业银锡	4,500	148,320.00	0.35
75	H00270	粤海投资	22,000	148,278.86	0.35
76	603638	艾迪精密	6,200	145,390.00	0.34
77	H02869	绿城服务	42,000	142,998.07	0.34
78	H02618	京东物流	13,900	141,855.93	0.33
79	605168	三人行	2,800	141,792.00	0.33
80	301031	中熔电气	1,184	141,428.80	0.33
81	002128	电投能源	6,100	141,032.00	0.33
82	300438	鹏辉能源	1,700	140,845.00	0.33
83	000001	平安银行	14,000	140,700.00	0.33
84	002812	恩捷股份	2,100	140,511.00	0.33
85	688146	中船特气	400	139,996.00	0.33
86	600026	中远海能	7,800	139,932.00	0.33
87	002468	申通快递	9,600	139,776.00	0.33
88	300769	德方纳米	2,100	139,650.00	0.33
89	300006	莱美药业	27,200	139,536.00	0.33
90	H02400	心动公司	3,600	139,141.71	0.33
91	002487	大金重工	2,400	139,128.00	0.33
92	002493	荣盛石化	12,900	138,675.00	0.33
93	688368	晶丰明源	640	138,572.80	0.33
94	H00856	伟仕佳杰	18,000	138,047.34	0.32
95	H09633	农夫山泉	4,000	137,647.80	0.32
96	600016	民生银行	42,700	137,494.00	0.32
97	002488	金固股份	15,300	136,323.00	0.32
98	000166	申万宏源	30,900	135,960.00	0.32
99	300857	协创数据	400	135,960.00	0.32
100	688388	嘉元科技	3,080	135,520.00	0.32

101	600166	福田汽车	46,400	135,024.00	0.32
102	H00257	光大环境	34,000	134,659.99	0.32
103	H01171	兖矿能源	14,000	134,364.69	0.32
104	000975	山金国际	7,900	134,300.00	0.32
105	301239	普瑞眼科	4,400	133,980.00	0.31
106	601995	中金公司	3,700	133,755.00	0.31
107	002709	天赐材料	2,600	133,718.00	0.31
108	600595	中孚实业	23,700	133,194.00	0.31
109	300681	英搏尔	4,600	131,652.00	0.31
110	002188	中天服务	26,800	131,320.00	0.31
111	601788	光大证券	9,100	131,313.00	0.31
112	600487	亨通光电	1,200	131,208.00	0.31
113	002384	东山精密	500	131,175.00	0.31
114	H01772	赣锋锂业	3,000	131,064.20	0.31
115	003816	中国广核	33,500	130,985.00	0.31
116	300547	川环科技	3,900	130,221.00	0.31
117	605098	行动教育	2,400	129,984.00	0.31
118	603091	众鑫股份	2,660	129,728.20	0.30
119	H00991	大唐发电	62,000	129,240.24	0.30
120	600426	华鲁恒升	5,400	129,168.00	0.30
121	605118	力鼎光电	3,700	129,093.00	0.30
122	002064	华峰化学	13,600	129,064.00	0.30
123	603093	南华期货	7,100	128,865.00	0.30
124	300005	探路者	5,700	128,820.00	0.30
125	002780	三夫户外	10,600	128,684.00	0.30
126	601339	百隆东方	19,000	128,630.00	0.30
127	000415	渤海租赁	31,600	128,612.00	0.30
128	600546	山煤国际	11,700	127,881.00	0.30
129	605189	富春染织	10,600	127,730.00	0.30
130	600018	上港集团	27,000	127,440.00	0.30
131	600522	中天科技	2,100	127,428.00	0.30
132	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.30
133	300034	钢研高纳	7,400	126,836.00	0.30
134	002660	茂硕电源	19,400	126,100.00	0.30
135	601699	潞安环能	8,800	125,664.00	0.30
136	688799	华纳药厂	2,800	125,636.00	0.30
137	605060	联德股份	2,200	124,828.00	0.29
138	301525	儒竞科技	2,640	124,634.40	0.29
139	002648	卫星化学	5,300	124,497.00	0.29
140	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.29
141	600662	外服控股	30,700	123,721.00	0.29
142	600955	维远股份	8,400	123,648.00	0.29
143	H01907	中国旭阳集	74,000	123,403.58	0.29

		团			
144	688785	恒运昌	256	123,368.80	0.29
145	002399	海普瑞	13,400	120,332.00	0.28
146	300249	依米康	7,800	120,120.00	0.28
147	600872	中炬高新	6,900	119,784.00	0.28
148	600561	江西长运	24,100	119,295.00	0.28
149	601233	桐昆股份	5,500	119,075.00	0.28
150	002388	新亚制程	22,700	118,948.00	0.28
151	301035	润丰股份	2,560	118,784.00	0.28
152	601949	中国出版	25,500	118,575.00	0.28
153	H02338	潍柴动力	4,000	118,470.22	0.28
154	002443	金洲管道	12,400	118,172.00	0.28
155	601222	林洋能源	22,100	117,572.00	0.28
156	002534	西子洁能	6,300	116,865.00	0.27
157	002466	天齐锂业	1,900	116,508.00	0.27
158	000301	东方盛虹	10,100	115,645.00	0.27
159	688351	微电生理	5,000	113,300.00	0.27
160	688155	先惠技术	1,400	113,246.00	0.27
161	605138	盛泰集团	20,400	112,608.00	0.26
162	300855	图南股份	3,600	112,536.00	0.26
163	600796	钱江生化	24,200	112,288.00	0.26
164	000935	四川双马	4,300	112,187.00	0.26
165	600683	京投发展	9,700	111,550.00	0.26
166	605598	上海港湾	2,900	111,447.00	0.26
167	002402	和而泰	4,300	111,069.00	0.26
168	002838	道恩股份	3,600	110,232.00	0.26
169	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.26
170	603881	数据港	4,400	110,000.00	0.26
171	688273	麦澜德	2,800	108,472.00	0.25
172	600590	泰豪科技	10,700	108,070.00	0.25
173	002105	信隆健康	21,700	107,198.00	0.25
174	301413	安培龙	1,500	106,320.00	0.25
175	603699	纽威股份	2,100	105,630.00	0.25
176	688523	航天环宇	2,000	104,800.00	0.25
177	300605	恒锋信息	11,200	103,488.00	0.24
178	000420	吉林化纤	25,300	102,465.00	0.24
179	603162	海通发展	11,320	101,540.40	0.24
180	301172	君逸数码	3,900	101,205.00	0.24
181	600348	华阳股份	13,200	100,980.00	0.24
182	603489	八方股份	3,600	100,656.00	0.24
183	688281	华秦科技	1,960	98,450.80	0.23
184	000619	海螺新材	22,300	98,120.00	0.23
185	003016	欣贺股份	16,000	98,080.00	0.23

186	600202	哈空调	21,800	97,664.00	0.23
187	002938	鹏鼎控股	900	94,842.00	0.22
188	600390	五矿资本	20,700	94,392.00	0.22
189	600266	城建发展	24,100	94,231.00	0.22
190	688012	中微公司	200	93,700.00	0.22
191	002142	宁波银行	3,100	92,039.00	0.22
192	603797	联泰环保	24,300	91,125.00	0.21
193	600388	龙净环保	6,200	90,210.00	0.21
194	688063	派能科技	1,600	85,232.00	0.20
195	000779	甘咨询	10,900	84,911.00	0.20
196	600620	天宸股份	21,200	83,740.00	0.20
197	300126	锐奇股份	13,700	79,186.00	0.19
198	300938	信测标准	1,560	77,812.80	0.18
199	603323	苏农银行	19,720	76,316.40	0.18
200	600371	万向德农	12,100	75,625.00	0.18
201	002494	华斯股份	17,000	75,480.00	0.18
202	002316	亚联发展	18,200	73,892.00	0.17
203	301339	通行宝	6,700	68,541.00	0.16
204	603317	天味食品	5,200	67,652.00	0.16
205	688285	高铁电气	9,400	67,398.00	0.16
206	001366	播恩集团	6,000	65,040.00	0.15
207	603506	南都物业	6,700	62,578.00	0.15
208	603879	永悦科技	13,300	60,116.00	0.14
209	603680	今创集团	6,100	59,841.00	0.14
210	601083	锦江航运	5,800	57,652.00	0.14
211	600493	凤竹纺织	11,000	57,640.00	0.14
212	000848	承德露露	7,700	56,980.00	0.13
213	601618	中国中冶	23,200	56,608.00	0.13
214	603711	香飘飘	5,000	55,550.00	0.13
215	000566	海南海药	11,100	55,389.00	0.13
216	002180	奔图科技	3,300	53,988.00	0.13
217	603878	武进不锈	10,100	51,914.00	0.12
218	300584	海辰药业	1,400	50,722.00	0.12
219	600178	东安动力	5,100	50,133.00	0.12
220	000756	新华制药	3,500	49,595.00	0.12
221	002728	特一药业	5,400	49,410.00	0.12
222	002907	华森制药	3,700	49,099.00	0.12
223	600720	中交设计	10,000	48,200.00	0.11
224	301558	三态股份	7,700	47,509.00	0.11
225	002550	千红制药	7,500	46,575.00	0.11
226	002313	日海智能	6,300	46,116.00	0.11
227	002238	天威视讯	8,400	45,360.00	0.11
228	002670	国盛证券	4,100	45,100.00	0.11

229	300722	新余国科	2,000	44,600.00	0.10
230	001296	长江材料	2,300	44,091.00	0.10
231	300289	利德曼	7,800	43,290.00	0.10
232	002247	聚力文化	20,400	43,044.00	0.10
233	688111	金山办公	200	42,610.00	0.10
234	002818	富森美	4,100	42,599.00	0.10
235	603106	恒银科技	6,100	42,395.00	0.10
236	600990	四创电子	2,400	42,312.00	0.10
237	300299	富春股份	8,500	41,650.00	0.10
238	600698	湖南天雁	7,000	41,440.00	0.10
239	600351	亚宝药业	7,200	41,400.00	0.10
240	002190	成飞集成	1,700	41,344.00	0.10
241	301277	新天地	4,700	41,125.00	0.10
242	002017	东信和平	2,800	40,964.00	0.10
243	002651	利君股份	5,600	40,936.00	0.10
244	300546	雄帝科技	2,700	40,932.00	0.10
245	600794	保税科技	14,300	40,755.00	0.10
246	601008	连云港	10,100	40,602.00	0.10
247	301533	威马农机	1,700	40,222.00	0.09
248	002104	恒宝股份	3,900	40,209.00	0.09
249	600967	内蒙一机	3,700	40,145.00	0.09
250	003029	吉大正元	2,500	40,050.00	0.09
251	603587	地素时尚	3,600	39,996.00	0.09
252	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.09
253	002097	山河智能	5,500	39,765.00	0.09
254	603280	南方路机	1,600	39,680.00	0.09
255	002882	金龙羽	2,100	39,669.00	0.09
256	001318	阳光乳业	4,000	39,640.00	0.09
257	000558	天府文旅	12,500	39,625.00	0.09
258	603086	先达股份	7,600	39,444.00	0.09
259	600117	西宁特钢	19,300	39,372.00	0.09
260	603967	中创物流	3,800	39,330.00	0.09
261	002103	广博股份	6,700	39,329.00	0.09
262	600167	联美控股	7,000	39,130.00	0.09
263	600598	北大荒	3,600	39,024.00	0.09
264	002908	德生科技	6,160	38,992.80	0.09
265	603192	汇得科技	2,300	38,962.00	0.09
266	002911	佛燃能源	4,100	38,909.00	0.09
267	605378	野马电池	2,800	38,808.00	0.09
268	603686	福龙马	3,000	38,760.00	0.09
269	002987	京北方	3,980	38,725.40	0.09
270	600398	海澜之家	7,400	38,702.00	0.09
271	002094	青岛金王	8,800	38,544.00	0.09

272	601606	长城军工	1,400	38,486.00	0.09
273	603198	迎驾贡酒	1,300	38,480.00	0.09
274	003040	楚天龙	3,600	38,232.00	0.09
275	600326	西藏天路	5,900	38,173.00	0.09
276	603706	东方环宇	2,200	38,038.00	0.09
277	603369	今世缘	1,600	37,936.00	0.09
278	002953	日丰股份	4,330	37,757.60	0.09
279	000020	深华发 A	3,400	37,060.00	0.09
280	688257	新锐股份	360	36,684.00	0.09
281	300529	健帆生物	2,300	35,420.00	0.08
282	600938	中国海油	1,300	35,295.00	0.08
283	603385	惠达卫浴	7,100	34,648.00	0.08
284	603676	卫信康	4,300	34,615.00	0.08
285	000989	九芝堂	4,400	34,188.00	0.08
286	600211	西藏药业	900	33,651.00	0.08
287	603233	大参林	2,200	33,066.00	0.08
288	002215	诺普信	4,000	32,920.00	0.08
289	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.08
290	002216	三全食品	2,800	32,284.00	0.08
291	002532	天山铝业	3,000	32,190.00	0.08
292	300743	天地数码	2,200	32,098.00	0.08
293	601600	中国铝业	3,900	32,058.00	0.08
294	002578	闽发铝业	9,900	31,185.00	0.07
295	300115	长盈精密	1,100	30,734.00	0.07
296	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.07
297	600718	东软集团	4,100	29,684.00	0.07
298	000858	五粮液	400	29,600.00	0.07
299	002027	分众传媒	5,900	28,556.00	0.07
300	300281	金明精机	4,700	28,341.00	0.07
301	002582	好想你	3,300	27,885.00	0.07
302	603508	思维列控	1,300	27,768.00	0.07
303	002763	汇洁股份	4,000	27,160.00	0.06
304	605136	丽人丽妆	3,800	27,094.00	0.06
305	002304	洋河股份	700	26,705.00	0.06
306	688503	聚和材料	200	26,540.00	0.06
307	300558	贝达药业	400	26,028.00	0.06
308	688003	天准科技	200	25,460.00	0.06
309	300128	锦富技术	4,300	25,456.00	0.06
310	600497	驰宏锌锗	2,100	25,431.00	0.06
311	300968	格林精密	2,600	25,064.00	0.06
312	300033	同花顺	100	24,100.00	0.06
313	688258	卓易信息	200	23,708.00	0.06
314	301189	奥尼电子	400	23,572.00	0.06

315	003006	百亚股份	1,600	23,216.00	0.05
316	000570	苏常柴 A	4,900	22,883.00	0.05
317	300434	金石亚药	2,000	22,460.00	0.05
318	603816	顾家家居	1,000	22,360.00	0.05
319	603027	千禾味业	3,200	22,304.00	0.05
320	300950	德固特	1,300	21,801.00	0.05
321	603365	水星家纺	1,400	21,798.00	0.05
322	300455	航天智装	1,000	21,540.00	0.05
323	000960	锡业股份	500	21,345.00	0.05
324	688580	伟思医疗	400	21,308.00	0.05
325	000776	广发证券	900	21,060.00	0.05
326	300591	万里马	3,100	20,863.00	0.05
327	301486	致尚科技	100	20,832.00	0.05
328	300458	全志科技	520	20,519.20	0.05
329	300059	东方财富	1,000	20,380.00	0.05
330	600489	中金黄金	1,100	19,855.00	0.05
331	600993	马应龙	900	19,458.00	0.05
332	601872	招商轮船	1,100	19,327.00	0.05
333	002801	微光股份	700	19,320.00	0.05
334	605099	共创草坪	600	19,320.00	0.05
335	603980	吉华集团	2,900	19,256.00	0.05
336	600887	伊利股份	800	19,168.00	0.05
337	603127	昭衍新药	500	19,110.00	0.04
338	603013	亚普股份	1,200	18,948.00	0.04
339	002278	神开股份	2,500	18,850.00	0.04
340	002107	沃华医药	3,300	18,777.00	0.04
341	603101	汇嘉时代	3,000	18,720.00	0.04
342	002182	宝武镁业	1,200	18,684.00	0.04
343	603883	老百姓	1,700	18,632.00	0.04
344	000603	盛达资源	800	18,480.00	0.04
345	603868	飞科电器	600	18,480.00	0.04
346	600738	丽尚国潮	5,100	18,360.00	0.04
347	001337	四川黄金	500	18,330.00	0.04
348	601061	中信金属	1,700	18,309.00	0.04
349	605033	美邦股份	1,100	18,304.00	0.04
350	600989	宝丰能源	900	18,297.00	0.04
351	002772	众兴菌业	1,600	18,176.00	0.04
352	600706	曲江文旅	2,700	18,171.00	0.04
353	002205	国统股份	1,800	18,162.00	0.04
354	000423	东阿阿胶	400	18,144.00	0.04
355	000157	中联重科	2,600	18,122.00	0.04
356	000612	焦作万方	1,700	18,003.00	0.04
357	603939	益丰药房	1,000	17,980.00	0.04

358	000554	泰山石油	3,200	17,952.00	0.04
359	002570	贝因美	4,500	17,910.00	0.04
360	688700	东威科技	200	17,880.00	0.04
361	002545	东方铁塔	1,100	17,842.00	0.04
362	002847	盐津铺子	400	17,840.00	0.04
363	603877	太平鸟	1,500	17,745.00	0.04
364	603071	物产环能	1,600	17,696.00	0.04
365	600750	华润江中	800	17,656.00	0.04
366	603421	鼎信通讯	2,800	17,220.00	0.04
367	000633	合金投资	3,600	17,136.00	0.04
368	603919	金徽酒	1,100	16,555.00	0.04
369	600132	重庆啤酒	400	16,520.00	0.04
370	002170	芭田股份	1,500	16,290.00	0.04
371	600028	中国石化	3,600	16,056.00	0.04
372	000596	古井贡酒	200	15,960.00	0.04
373	688349	三一重能	1,040	15,787.20	0.04
374	002267	陕天然气	2,400	15,696.00	0.04
375	002345	潮宏基	1,700	15,589.00	0.04
376	688660	电气风电	1,800	15,516.00	0.04
377	000568	泸州老窖	200	15,504.00	0.04
378	601018	宁波港	4,900	15,435.00	0.04
379	603998	方盛制药	1,700	15,351.00	0.04
380	301358	湖南裕能	200	15,174.00	0.04
381	600099	林海股份	1,900	15,162.00	0.04
382	603518	锦泓集团	2,100	15,015.00	0.04
383	300785	值得买	400	14,668.00	0.03
384	688553	汇宇制药	1,376	14,626.88	0.03
385	601998	中信银行	2,100	14,553.00	0.03
386	601700	风范股份	3,300	14,388.00	0.03
387	000538	云南白药	300	14,211.00	0.03
388	000408	藏格矿业	200	13,864.00	0.03
389	600251	冠农股份	1,600	13,824.00	0.03
390	600429	三元股份	3,200	12,928.00	0.03
391	000973	佛塑科技	900	12,915.00	0.03
392	002727	一心堂	1,300	12,467.00	0.03
393	601801	皖新传媒	2,000	9,860.00	0.02
394	601068	中铝国际	2,200	9,504.00	0.02
395	300597	吉大通信	1,300	9,204.00	0.02
396	300615	欣天科技	900	9,027.00	0.02
397	300512	中亚股份	1,300	8,866.00	0.02
398	002197	证通电子	1,300	7,462.00	0.02
399	002439	启明星辰	500	6,325.00	0.01
400	600287	苏豪时尚	1,200	5,292.00	0.01

401	002379	宏桥控股	300	4,431.00	0.01
402	600787	中储股份	1,000	4,180.00	0.01
403	002355	兴民智通	800	3,440.00	0.01
404	601608	中信重工	700	3,339.00	0.01
405	688244	永信至诚	200	2,852.00	0.01
406	603029	天鹅股份	200	2,812.00	0.01
407	600929	雪天盐业	500	2,270.00	0.01
408	601112	振石股份	97	1,706.23	0.00
409	300074	华平股份	500	1,700.00	0.00
410	603352	至信股份	38	969.76	0.00
411	002454	松芝股份	200	956.00	0.00
412	603176	汇通集团	100	428.00	0.00
413	002666	德联集团	100	395.00	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	603259	药明康德	1,852,240.00	1.69
1	H02359	药明康德	1,226,710.97	1.12
2	301345	涛涛车业	1,464,771.00	1.33
3	H06160	百济神州	984,097.40	0.90
3	688235	百济神州	470,022.38	0.43
4	H00016	新鸿基地产	1,438,339.82	1.31
5	300750	宁德时代	1,432,395.00	1.30
6	601899	紫金矿业	1,022,396.00	0.93
6	H02899	紫金矿业	386,467.49	0.35
7	H00991	大唐发电	1,256,854.24	1.14
7	601991	大唐发电	66,395.00	0.06
8	002028	思源电气	1,323,197.00	1.20
9	301031	中熔电气	1,308,322.00	1.19
10	603444	吉比特	1,198,740.00	1.09
11	H01772	赣锋锂业	1,122,288.65	1.02
11	002460	赣锋锂业	14,182.00	0.01
12	688981	中芯国际	574,354.64	0.52
12	H00981	中芯国际	536,660.55	0.49
13	H00288	万洲国际	1,083,495.92	0.99
14	H00270	粤海投资	1,080,058.07	0.98
15	000338	潍柴动力	747,637.00	0.68
15	H02338	潍柴动力	319,611.91	0.29
16	300926	博俊科技	1,047,369.58	0.95

17	002475	立讯精密	1,031,223.00	0.94
18	H01347	华虹宏力	1,015,682.16	0.92
19	H02208	金风科技	1,002,466.80	0.91
20	H06869	长飞光纤光缆	840,116.96	0.76
20	601869	长飞光纤	153,194.00	0.14

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	603259	药明康德	2,545,610.00	2.32
1	H02359	药明康德	1,082,616.78	0.99
2	603444	吉比特	1,850,729.00	1.68
3	H06160	百济神州	936,939.17	0.85
3	688235	百济神州	889,720.55	0.81
4	H00991	大唐发电	1,168,333.63	1.06
4	601991	大唐发电	501,831.00	0.46
5	002028	思源电气	1,580,456.00	1.44
6	601899	紫金矿业	1,166,465.00	1.06
6	H02899	紫金矿业	326,961.98	0.30
7	688200	华峰测控	1,471,061.04	1.34
8	H00016	新鸿基地产	1,429,392.73	1.30
9	301345	涛涛车业	1,370,633.00	1.25
10	301031	中熔电气	1,357,629.00	1.24
11	601865	福莱特	1,354,696.00	1.23
12	300926	博俊科技	1,268,627.31	1.15
13	603929	亚翔集成	1,254,413.81	1.14
14	H02628	中国人寿	630,470.74	0.57
14	601628	中国人寿	623,817.00	0.57
15	301607	富特科技	1,188,946.00	1.08
16	000852	石化机械	1,166,142.00	1.06
17	000338	潍柴动力	922,414.00	0.84
17	H02338	潍柴动力	211,460.88	0.19
18	300750	宁德时代	1,133,585.80	1.03
19	603993	洛阳钼业	649,641.00	0.59
19	H03993	洛阳钼业	465,552.34	0.42
20	301377	鼎泰高科	1,100,797.00	1.00

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	346,198,503.09
卖出股票收入（成交）总额	405,795,731.27

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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。

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	1,692,665.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	26,307.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	980,252.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,699,225.14

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	351,812.00	0.83	停牌

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
创金合信均	412	61,114.28	-	-	25,179,084.	100.00%

益量化选股混合 A					83	
创金合信均益量化选股混合 C	252	29,804.28	-	-	7,510,677.73	100.00%
合计	650	50,291.94	-	-	32,689,762.56	100.00%

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

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	47.93%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信均益量化选股混合 A	268,672.96	1.07%
	创金合信均益量化选股混合 C	13,437.18	0.18%
	合计	282,110.14	0.86%

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信均益量化选股混合 A	10~50
	创金合信均益量化选股混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信均益量化选股混合 A	0~10
	创金合信均益量化选股混合 C	0

	C	
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信均益量 化选股混合 A	创金合信均益 量化选股混合 C
基金合同生效日(2024 年 6 月 27 日)基金份额总额	94,476,813.37	143,847,481.58
本报告期期初基金份额总额	58,589,687.76	26,455,961.42
本报告期基金总申购份额	22,840,094.52	647,973.17
减：本报告期基金总赎回份额	56,250,697.45	19,593,256.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,179,084.83	7,510,677.73

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，基金托管人未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未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	
中银国际证券	4	626,409,789.45	83.30%	276,191.39	81.68%	-
中信建投证券	4	125,541,764.65	16.70%	61,940.84	18.32%	-

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
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

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	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
3	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-20
4	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金（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
5	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-25
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§ 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

本基金本报告期末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、《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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