

创金合信鑫祥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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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.....	4
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.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
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.....	8
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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	39
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.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
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.....	48

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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 盈利投资者数量占比	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信鑫祥混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信鑫祥混合	
基金主代码	010605	
交易代码	010605	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,346,434,943.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C
下属分级基金的交易代码	010605	010606
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,075,971,429.96 份	2,270,463,513.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，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。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
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	95580
传真	0755-25832571	010-86353609
注册地址	深圳市前海深港合作区南山街道时代大街 200	北京市西城区金融大街 3 号

	号创金大厦 3101	
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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518052	100808
法定代表人	青美平措	郑国雨

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	证券日报
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、创金合信鑫祥混合 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	-17,921,816.25
本期利润	-34,312,860.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0330
本期加权平均净值利润率	-2.58%
本期基金份额净值增长率	-1.17%
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	276,775,822.11
期末可供分配基金份额利润	0.2572
期末基金资产净值	1,352,747,252.07

期末基金份额净值	1.2572
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	25.72%

2、创金合信鑫祥混合 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	-30,432,691.45
本期利润	-71,312,198.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0290
本期加权平均净值利润率	-2.31%
本期基金份额净值增长率	-1.36%
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	518,928,031.48
期末可供分配基金份额利润	0.2286
期末基金资产净值	2,789,391,545.23
期末基金份额净值	1.2286
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	22.86%

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

创金合信鑫祥混合 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	-1.33%	0.26%	2.86%	0.26%	-4.19%	0.00%
过去六个月	-1.17%	0.25%	2.33%	0.23%	-3.50%	0.02%
过去一年	2.85%	0.21%	4.56%	0.20%	-1.71%	0.01%
过去三年	13.66%	0.26%	10.44%	0.21%	3.22%	0.05%
过去五年	25.08%	0.29%	7.04%	0.22%	18.04%	0.07%
自基金合同 生效起至今	25.72%	0.28%	6.69%	0.22%	19.03%	0.06%

创金合信鑫祥混合 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	-1.42%	0.26%	2.86%	0.26%	-4.28%	0.00%
过去六个月	-1.36%	0.25%	2.33%	0.23%	-3.69%	0.02%
过去一年	2.45%	0.21%	4.56%	0.20%	-2.11%	0.01%
过去三年	12.28%	0.26%	10.44%	0.21%	1.84%	0.05%
过去五年	22.59%	0.29%	7.04%	0.22%	15.55%	0.07%
自基金合同 生效起至今	22.86%	0.28%	6.69%	0.22%	16.17%	0.06%

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

创金合信鑫祥混合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
(2021年02月04日-2026年06月30日)



创金合信鑫祥混合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
(2021年02月04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		
刘润哲	本基金基金经理、稳健收益投资部负责人、多资产投资管理部执行总监	2022 年 10 月 18 日	-	14	刘润哲先生，中国国籍，康涅狄格大学硕士。2011 年 9 月加入美林银行（Merrill Lynch），任投资顾问，2012 年 9 月加入中国人寿保险股份有限公司，任精算部主管，2016 年 1 月加入中国民生银行股份有限公司，任资产管理部投资经理，2022 年 5 月加入创金合信基金管理有限公司，现任稳健收益投资部负责人、兼任多资产投资管理部执行总监、基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制

风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十二条规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人会在十个交易日内进行调整。

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

一季度经济数据较平稳，PPI 同比负增长有所缩窄，CPI 温和增长，地产数据仍有惯性下滑，但幅度有所缓解，企业 ROE 小幅修复，市场整体处于较为均衡的状态，1-2 月股票市场延续温和上涨，3 月美伊冲突导致市场对于商品价格、制造业、企业盈利预期出现大幅波动，股票整体出现明显回调。二季度海外美伊冲突等整体仍维持扰动，地缘风险并未实质性解除，科技板块伴随短期产业基本面强势驱动力下独立走强，同时对其他板块形成资金虹吸效应，市场表现分化严重。债券市场央行 3 月开始通过调减了 3 个月、6 个月期买断式逆回购与 MLF（中期借贷便利）的投放规模，连续数月采取缩量续作模式，通过适度回笼冗余流动性，引导市场利率向政策中枢回归。随着央行持续加大回笼力度，在 5 月中旬开始流动性开始出现边际收敛迹象，跨月后趋势进一步强化，6 月 3 日和 6 月 4 日出现零投放，同业活期存款流失加速导致大行净融出规模大幅下降，债市行情开始调整，收益率曲线重新对资金中枢进行定价。直至 6 月 25 日 MLF 加量续作 5000 亿，意味着央行前期流动性回笼周期接近尾声，债市迎来修复。从组合角度看，产品保持均衡的配置风格，以定价合理性为出发点进行组合优化配置，成长板块重点关注业绩兑现度高和远期成长空间置信度逐步提升的板块；此外随着美联储政策逐步回归相机抉择、地缘风险边际缓和，低估值板块有

望迎来修复，产品维持在科技、传统制造业、化工、有色、航空、农业、环保等价值板块进行均衡配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫祥混合 A 基金份额净值为 1.2572 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.17%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%；截至本报告期末创金合信鑫祥混合 C 基金份额净值为 1.2286 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年市场相对重要的变化，一个是宏观风险因子的边际缓释，资产定价重新回到产业和基本面逻辑，伴随美伊阶段性协议达成，原油为主的大宗商品价格快速回落，后续商品价格波动率有望明显下降。对应到顺周期资产，分子端波动率降低，有助于市场相关方向的盈利预期逐步企稳。二是科技板块在强势的基本面支撑下快速冲高后双向波动率也开始显著放大，高位科技资产在市场资金分歧扰动结束后，将回归产业自身交易逻辑。价值类资产在持续资金流出后配置性价比进一步提升，两端资产的风险都会有一定缓释，经济层面在上半年出口强劲的背景下，经济总量压力不大，政治局会议内容体现较为温和的政策引导，财政逆周期调节力度和节奏相对都会缓和，配置层面相对更看好处于 k 型内需特征两端的资产。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在创金合信鑫祥混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：创金合信鑫祥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	29,407,410.13	111,842,565.53
结算备付金		39,145,044.58	21,753,292.59
存出保证金		1,053,457.02	256,646.80
交易性金融资产	6.4.7.2	3,526,869,734.96	1,644,493,924.87
其中：股票投资		734,097,843.11	365,192,419.36

基金投资		-	-
债券投资		2,792,771,891.85	1,279,301,505.51
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	500,000,000.00	-26,104.11
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		153,890,655.78	111,314,369.58
应收股利		-	-
应收申购款		417,250.72	32,183,684.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,250,783,553.19	1,921,818,379.33
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		62,520,602.67	-
应付清算款		-	4,491,128.07
应付赎回款		39,769,446.71	7,361,451.33
应付管理人报酬		2,897,218.84	1,284,412.36
应付托管费		362,152.34	160,551.55
应付销售服务费		969,042.40	505,911.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		47,599.17	25,284.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,078,693.76	771,843.75
负债合计		108,644,755.89	14,600,583.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,346,434,943.71	1,523,571,163.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	795,703,853.59	383,646,632.04
净资产合计		4,142,138,797.30	1,907,217,795.97
负债和净资产总计		4,250,783,553.19	1,921,818,379.33

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，创金合信鑫祥混合 A 份额净值 1.2572 元，基金份额总额 1,075,971,429.96 份；创金合信鑫祥混合 C 份额净值 1.2286 元，基金份额总额 2,270,463,513.75 份；总份额合计 3,346,434,943.71 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信鑫祥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		-79,737,094.03	2,155,506.47
1.利息收入		7,734,479.04	111,148.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,203,182.82	20,315.62
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		6,531,296.22	90,832.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-32,019,535.23	1,789,185.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-60,891,188.52	971,743.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	24,720,386.66	694,194.69
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	4,151,266.63	123,247.33
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）	6.4.7.17	-57,270,551.61	152,612.49
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	1,818,513.77	102,560.17
减：二、营业总支出		25,887,965.28	411,090.65

1.管理人报酬	6.4.10.2.1	17,423,174.58	285,579.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	2,177,896.81	35,697.49
3.销售服务费	6.4.10.2.3	6,100,768.64	84,585.39
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		50,477.51	4,896.62
其中：卖出回购金融资产支出		50,477.51	4,896.62
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		26,585.39	331.48
8.其他费用	6.4.7.21	109,062.35	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-105,625,059.31	1,744,415.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-105,625,059.31	1,744,415.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-105,625,059.31	1,744,415.82

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信鑫祥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	1,523,571,163.93	-	383,646,632.04	1,907,217,795.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,523,571,163.93	-	383,646,632.04	1,907,217,795.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,822,863,779.78	-	412,057,221.55	2,234,921,001.33
（一）、综合收益总额	-	-	-105,625,059.31	-105,625,059.31
（二）、本期基金份额交易产生的	1,822,863,779.78	-	517,682,280.86	2,340,546,060.64

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1.基金申购 款	4,054,225,716.57	-	1,084,742,962.91	5,138,968,679.48
2.基金赎回 款	-2,231,361,936.79	-	-567,060,682.05	-2,798,422,618.84
(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	3,346,434,943.71	-	795,703,853.59	4,142,138,797.30
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	46,201,391.74	-	7,964,823.37	54,166,215.11
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	46,201,391.74	-	7,964,823.37	54,166,215.11
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	140,661,487.34	-	30,317,877.55	170,979,364.89
(一)、综合收益 总额	-	-	1,744,415.82	1,744,415.82
(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)	140,661,487.34	-	28,573,461.73	169,234,949.07
其中：1.基金申购 款	176,365,366.10	-	35,037,942.04	211,403,308.14
2.基金赎回 款	-35,703,878.76	-	-6,464,480.31	-42,168,359.07
(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	186,862,879.08	-	38,282,700.92	225,145,580.00

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

创金合信鑫祥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”)2020年8月6日证监许可[2020]1690号文《关于准予创金合信鑫祥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《创金合信鑫祥混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2021年2月4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206,745,729.86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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)。

本基金于2020年11月10日至2021年2月1日募集,募集期间净认购资金人民币206,737,549.63元,认购资金在募集期间产生的利息人民币8,180.23元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计206,745,729.86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2100094号验资报告。

根据《创金合信鑫祥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、《创金合信鑫祥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《创金合信鑫祥混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、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、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货等)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)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—40%；本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+中债综合指数收益率 $\times$ 80%。

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》、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》、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) 对本基金从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。

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。

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。

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。

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	29,407,410.13
等于：本金	29,359,524.48
加：应计利息	47,885.65
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	29,407,410.13

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		801,350,311.13	-	734,097,843.11	-67,252,468.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	415,299,466.20	3,905,565.48	418,729,316.78	-475,714.90
	银行间市场	2,341,935,475.10	19,025,375.07	2,374,042,575.07	13,081,724.90
	合计	2,757,234,941.30	22,930,940.55	2,792,771,891.85	12,606,010.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,558,585,252.43	22,930,940.55	3,526,869,734.96	-54,646,458.02

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000,000.00	-

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	27,714.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,951,216.98
其中：交易所市场	1,943,417.45
银行间市场	7,799.53
应付利息	-

预提费用	99,762.35
合计	2,078,693.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信鑫祥混合 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	359,984,800.40	359,984,800.40
本期申购	1,073,663,714.35	1,073,663,714.35
本期赎回（以“-”号填列）	-357,677,084.79	-357,677,084.79
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	1,075,971,429.96	1,075,971,429.96

创金合信鑫祥混合 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	1,163,586,363.53	1,163,586,363.53
本期申购	2,980,562,002.22	2,980,562,002.22
本期赎回（以“-”号填列）	-1,873,684,852.00	-1,873,684,852.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	2,270,463,513.75	2,270,463,513.75

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

创金合信鑫祥混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	109,054,155.39	-11,103,776.33	97,950,379.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	109,054,155.39	-11,103,776.33	97,950,379.06
本期利润	-17,921,816.25	-16,391,044.54	-34,312,860.79
本期基金份额交易产生的变动数	225,355,801.03	-12,217,497.19	213,138,303.84
其中：基金申购款	338,090,455.74	-26,451,638.83	311,638,816.91
基金赎回款	-112,734,654.71	14,234,141.64	-98,500,513.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	316,488,140.17	-39,712,318.06	276,775,822.11

创金合信鑫祥混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	321,866,838.81	-36,170,585.83	285,696,252.98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	321,866,838.81	-36,170,585.83	285,696,252.98
本期利润	-30,432,691.45	-40,879,507.07	-71,312,198.52
本期基金份额交易产生的变动数	311,534,881.74	-6,990,904.72	304,543,977.02
其中：基金申购款	849,834,045.59	-76,729,899.59	773,104,146.00
基金赎回款	-538,299,163.85	69,738,994.87	-468,560,168.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	602,969,029.10	-84,040,997.62	518,928,031.48

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	1,118,482.24
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	80,375.08
其他	4,325.50
合计	1,203,182.82

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	-60,891,188.52
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	-60,891,188.52

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	3,285,890,052.87
减：卖出股票成本总额	3,341,463,934.66
减：交易费用	5,317,306.73
买卖股票差价收入	-60,891,188.52

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**

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	24,284,657.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	435,729.33
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	24,720,386.66

6.4.7.12.2 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	146,462,935.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	144,439,469.72
减：应计利息总额	1,574,722.06
减：交易费用	13,013.92
买卖债券差价收入	435,729.33

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	4,151,266.63

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	4,151,266.63

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	-57,270,551.61
——股票投资	-72,007,567.21
——债券投资	14,737,015.60
——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	-57,270,551.61

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	1,776,907.54
转换费收入	41,606.23
合计	1,818,513.77

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	30,954.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	109,062.35

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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
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

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		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	122,805,924.07	1.74%	-	-

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

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	47,276.90	1.47%	21,599.76	1.11%
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	-	-	-	-

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。

6.4.10.2 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	17,423,174.58	285,579.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,286,781.67	87,651.41
应支付基金管理人的净管理费	9,136,392.91	197,928.26

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 0.8% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

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	2,177,896.81	35,697.49

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

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		
	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C	合计
创金合信直销	-	44,306.38	44,306.38
邮储银行	-	1,386.83	1,386.83
合计	-	45,693.21	45,693.21
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		
	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C	合计
创金合信直销	-	19,827.54	19,827.54
邮储银行	-	0.98	0.98
合计	-	19,828.52	19,828.52

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 0.4% 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：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C
报告期初持有的基金份额	5,610,737.00	800,080.01
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	5,610,737.00	800,080.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.29%	0.57%

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。

6.4.10.5.2 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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至
-------	-----------------------------	-------------------------

	月 30 日		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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	29,407,410.13	1,118,482.24	5,694,843.66	19,305.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月以上	新股锁定	114.28	676.94	6,398	731,163.44	4,331,062.12	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	1-6 个月（含）	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	1-6 个月（含）	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月（含）	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	1-6 个月（含）	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026 年	1-6 个	新股锁	69.66	160.0	714	49,737.24	114,282.84	-

		3 月 18 日	月（含）	定		6				
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月（含）	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月（含）	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月（含）	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	1-6 个月（含）	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	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	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月（含）	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	1-6 个月（含）	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月（含）	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	1-6 个月（含）	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	1-6 个月（含）	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
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	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
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	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	1-6 个 月（含）	新股锁 定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 62,520,602.67 元，于 2026 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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中国邮政储蓄银行股份有限公司，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

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	344,072,637.96	108,800,285.37
合计	344,072,637.96	108,800,285.37

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。

6.4.13.2.2 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

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	99,730,256.52	-
合计	99,730,256.52	-

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	1,444,283,780.04	448,872,756.77
AAA 以下	7,102,156.88	15,557,176.78
未评级	897,583,060.45	706,071,286.59
合计	2,348,968,997.37	1,170,501,220.14

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。

6.4.13.2.5 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，除卖出回购金融资产款余额中有 62,536,218.7 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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，因此账面余额约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发行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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	29,407,410.13	-	-	-	29,407,410.13
结算备付金	39,145,044.58	-	-	-	39,145,044.58

存出保证金	1,053,457.02	-	-	-	1,053,457.02
交易性金融资产	558,692,726.17	2,021,898,166.18	212,180,999.50	734,097,843.11	3,526,869,734.96
买入返售金融资产	500,000,000.00	-	-	-	500,000,000.00
应收申购款	-	-	-	417,250.72	417,250.72
应收清算款	-	-	-	153,890,655.78	153,890,655.78
资产总计	1,128,298,637.90	2,021,898,166.18	212,180,999.50	888,405,749.61	4,250,783,553.19
负债					
卖出回购金融资产款	62,520,602.67	-	-	-	62,520,602.67
应付赎回款	-	-	-	39,769,446.71	39,769,446.71
应付管理人报酬	-	-	-	2,897,218.84	2,897,218.84
应付托管费	-	-	-	362,152.34	362,152.34
应付销售服务费	-	-	-	969,042.40	969,042.40
应交税费	-	-	-	47,599.17	47,599.17
其他负债	-	-	-	2,078,693.76	2,078,693.76
负债总计	62,520,602.67	-	-	46,124,153.22	108,644,755.89
利率敏感度缺口	1,065,778,035.23	2,021,898,166.18	212,180,999.50	842,281,596.39	4,142,138,797.30
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	111,842,565.53	-	-	-	111,842,565.53
结算备付金	21,753,292.59	-	-	-	21,753,292.59
存出保证金	256,646.80	-	-	-	256,646.80
交易性金融资产	151,652,913.74	1,075,030,878.31	52,617,713.46	365,192,419.36	1,644,493,924.87
买入返售金融资产	-26,104.11	-	-	-	-26,104.11
应收申购款	-	-	-	32,183,684.07	32,183,684.07
应收清算款	-	-	-	111,314,369.58	111,314,369.58

资产总计	285,479,314.55	1,075,030,878.31	52,617,713.46	508,690,473.01	1,921,818,379.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,361,451.33	7,361,451.33
应付管理人报酬	-	-	-	1,284,412.36	1,284,412.36
应付托管费	-	-	-	160,551.55	160,551.55
应付销售服务费	-	-	-	505,911.87	505,911.87
应交税费	-	-	-	25,284.43	25,284.43
应付清算款	-	-	-	4,491,128.07	4,491,128.07
其他负债	-	-	-	771,843.75	771,843.75
负债总计	-	-	-	14,600,583.36	14,600,583.36
利率敏感度缺口	285,479,314.55	1,075,030,878.31	52,617,713.46	494,089,889.65	1,907,217,795.97

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

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	-21,723,227.06	-7,604,099.39
	2.市场利率平行下降 25 个基点	22,267,119.39	7,685,472.56

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

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	734,097,843.11	17.72	365,192,419.36	19.15
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	734,097,843.11	17.72	365,192,419.36	19.15

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%	34,087,833.34	11,565,643.92
	2.业绩比较基准下降 5%	-34,087,833.34	-11,565,643.92

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	735,039,925.85
第二层次	2,785,665,102.49
第三层次	6,164,706.62
合计	3,526,869,734.96

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	734,097,843.11	17.27
	其中：股票	734,097,843.11	17.27

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,792,771,891.85	65.70
	其中：债券	2,792,771,891.85	65.70
	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	500,000,000.00	11.76
	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	68,552,454.71	1.61
8	其他各项资产	155,361,363.52	3.65
9	合计	4,250,783,553.19	100.00

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	7,752.00	0.00
B	采矿业	37,843,479.46	0.91
C	制造业	518,971,648.22	12.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	968,805.00	0.02
E	建筑业	11,004.00	0.00
F	批发和零售业	49,556.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	65,204,539.31	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,561,477.72	0.11
J	金融业	37,157.00	0.00
K	房地产业	5,556.00	0.00
L	租赁和商务服务业	53,114,416.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	301,852.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	53,015,644.00	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,956.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	734,097,843.11	17.72

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600885	宏发股份	1,589,280	54,814,267.20	1.32
2	002027	分众传媒	10,973,200	53,110,288.00	1.28
3	600323	瀚蓝环境	1,894,500	52,022,970.00	1.26
4	300750	宁德时代	107,900	42,405,779.00	1.02
5	601111	中国国航	6,407,437	38,764,993.85	0.94
6	300037	新宙邦	374,800	34,800,180.00	0.84
7	002106	莱宝高科	1,708,000	29,924,160.00	0.72
8	000425	徐工机械	3,538,600	28,627,274.00	0.69
9	300138	晨光生物	3,060,356	27,543,204.00	0.66
10	600160	巨化股份	472,100	25,026,021.00	0.60
11	600547	山东黄金	981,340	22,659,140.60	0.55
12	600346	恒力石化	1,262,700	22,362,417.00	0.54
13	688301	奕瑞科技	177,407	21,998,468.00	0.53
14	600352	浙江龙盛	1,713,200	20,746,852.00	0.50
15	300394	天孚通信	64,560	19,541,020.80	0.47
16	300656	民德电子	493,600	18,801,224.00	0.45
17	000100	TCL 科技	2,884,600	16,788,372.00	0.41
18	301631	壹连科技	227,020	16,313,657.20	0.39
19	601898	中煤能源	1,224,575	14,915,323.50	0.36
20	600482	中国动力	427,600	14,025,280.00	0.34

				0	
21	300274	阳光电源	87,700	13,946,054.00	0.34
22	300308	中际旭创	10,900	13,843,000.00	0.33
23	600603	广汇物流	3,131,600	13,622,460.00	0.33
24	600115	中国东航	3,342,000	12,733,020.00	0.31
25	600458	时代新材	677,600	11,214,280.00	0.27
26	002850	科达利	52,300	9,900,390.00	0.24
27	600737	中粮糖业	770,900	9,505,197.00	0.23
28	002595	豪迈科技	166,297	7,749,440.20	0.19
29	300903	科翔股份	60,300	6,108,993.00	0.15
30	603005	晶方科技	89,659	4,829,930.33	0.12
31	600418	江淮汽车	176,200	4,551,246.00	0.11
32	688099	晶晨股份	43,457	4,471,725.30	0.11
33	002056	横店东磁	144,700	4,410,456.00	0.11
34	688239	航宇科技	72,452	4,334,803.16	0.10
35	688795	摩尔线程	6,398	4,331,062.12	0.10
36	601231	环旭电子	130,600	4,231,440.00	0.10
37	603989	艾华集团	79,000	4,147,500.00	0.10
38	600563	法拉电子	21,100	4,025,880.00	0.10
39	603861	白云电器	296,600	3,829,106.00	0.09
40	601799	星宇股份	35,500	3,217,010.00	0.08
41	603639	海利尔	283,500	2,812,320.00	0.07
42	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.03
43	001233	海安集团	23,156	1,035,073.20	0.02
44	002627	三峡旅游	169,000	964,990.00	0.02
45	600285	羚锐制药	42,300	819,774.00	0.02
46	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
47	688635	长进光子	1,271	558,941.82	0.01
48	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.01
49	600905	三峡能源	136,200	505,302.00	0.01
50	600674	川投能源	31,200	442,104.00	0.01
51	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
52	601965	中国汽研	21,562	257,881.52	0.01
53	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.01
54	001288	运机集团	7,700	183,183.00	0.00
55	920599	同力股份	10,932	180,050.04	0.00
56	920045	衡东光	256	161,308.16	0.00
57	600887	伊利股份	6,400	153,344.00	0.00
58	001280	中国铀业	2,277	151,875.90	0.00

59	688722	同益中	7,971	120,920.07	0.00
60	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
61	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
62	002928	华夏航空	11,800	82,482.00	0.00
63	300408	三环集团	462	77,107.80	0.00
64	600028	中国石化	16,334	72,849.64	0.00
65	603279	景津装备	5,900	70,800.00	0.00
66	603435	嘉德利	1,031	68,134.86	0.00
67	600089	特变电工	2,900	65,250.00	0.00
68	000913	钱江摩托	6,300	64,575.00	0.00
69	001237	惠康科技	947	64,219.54	0.00
70	688234	天岳先进	338	58,646.38	0.00
71	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
72	603129	春风动力	200	51,160.00	0.00
73	688012	中微公司	100	46,850.00	0.00
74	300888	稳健医疗	1,600	44,784.00	0.00
75	688256	寒武纪	28	44,675.40	0.00
76	301629	矽电股份	100	43,040.00	0.00
77	002876	三利谱	1,200	42,252.00	0.00
78	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
79	603260	合盛硅业	800	38,608.00	0.00
80	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
81	002475	立讯精密	500	35,200.00	0.00
82	000786	北新建材	1,900	34,371.00	0.00
83	603529	爱玛科技	1,500	29,265.00	0.00
84	002833	弘亚数控	1,500	28,935.00	0.00
85	601601	中国太保	1,000	28,520.00	0.00
86	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
87	603568	伟明环保	1,800	27,684.00	0.00
88	688385	复旦微电	381	27,161.49	0.00
89	600595	中孚实业	4,200	23,604.00	0.00
90	300879	大叶股份	1,500	23,520.00	0.00
91	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
92	300957	贝泰妮	700	22,057.00	0.00
93	600585	海螺水泥	1,300	22,035.00	0.00
94	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.00
95	600483	福能股份	2,100	21,399.00	0.00
96	688615	合合信息	189	21,375.90	0.00
97	600710	苏美达	2,200	21,032.00	0.00
98	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
99	688372	伟测科技	108	20,088.00	0.00
100	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
101	301031	中熔电气	148	17,678.60	0.00

102	600801	华新建材	1,100	17,160.00	0.00
103	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.00
104	002701	奥瑞金	3,900	16,614.00	0.00
105	603786	科博达	400	16,364.00	0.00
106	601607	上海医药	1,000	15,400.00	0.00
107	002025	航天电器	200	15,244.00	0.00
108	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
109	300001	特锐德	400	15,132.00	0.00
110	688231	隆达股份	411	15,096.03	0.00
111	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
112	688052	纳芯微	52	14,992.12	0.00
113	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
114	002180	奔图科技	900	14,724.00	0.00
115	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
116	002096	易普力	1,600	14,048.00	0.00
117	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
118	688261	东微半导	127	13,326.11	0.00
119	300893	松原安全	800	12,960.00	0.00
120	002182	宝武镁业	800	12,456.00	0.00
121	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
122	920982	锦波生物	97	12,221.03	0.00
123	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
124	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
125	300759	康龙化成	400	11,572.00	0.00
126	002140	东华科技	1,200	11,004.00	0.00
127	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
128	920394	民士达	153	10,549.35	0.00
129	688036	传音控股	178	10,493.10	0.00
130	600486	扬农化工	200	10,140.00	0.00
131	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
132	600409	三友化工	1,650	10,081.50	0.00
133	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
134	688789	宏华数科	187	9,942.79	0.00
135	603799	华友钴业	200	9,652.00	0.00
136	600010	宝钢股份	4,300	9,589.00	0.00
137	688155	先惠技术	111	8,978.79	0.00
138	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.00
139	603688	石英股份	100	8,261.00	0.00
140	601225	陕西煤业	400	8,140.00	0.00
141	002221	东华能源	1,500	7,890.00	0.00
142	603092	德力佳	146	7,879.62	0.00
143	300014	亿纬锂能	119	7,738.57	0.00
144	002318	久立特材	300	7,170.00	0.00

145	603766	隆鑫通用	600	7,158.00	0.00
146	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
147	002714	牧原股份	200	6,998.00	0.00
148	603179	新泉股份	140	6,951.00	0.00
149	002782	可立克	300	6,315.00	0.00
150	603899	晨光股份	300	6,189.00	0.00
151	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
152	600507	方大特钢	1,500	6,075.00	0.00
153	688382	益方生物	320	5,760.00	0.00
154	600048	保利发展	1,200	5,556.00	0.00
155	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
156	002736	国信证券	500	4,995.00	0.00
157	300015	爱尔眼科	600	4,956.00	0.00
158	603556	海兴电力	200	4,400.00	0.00
159	688408	中信博	135	4,340.25	0.00
160	300058	蓝色光标	300	4,128.00	0.00
161	002885	京泉华	100	4,086.00	0.00
162	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
163	301365	矩阵股份	100	3,791.00	0.00
164	601288	农业银行	600	3,642.00	0.00
165	603227	雪峰科技	500	3,510.00	0.00
166	300494	盛天网络	400	3,372.00	0.00
167	002493	荣盛石化	300	3,225.00	0.00
168	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
169	000792	盐湖股份	100	3,019.00	0.00
170	601567	三星电气	200	2,988.00	0.00
171	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
172	000915	华特达因	100	2,831.00	0.00
173	000963	华东医药	100	2,812.00	0.00
174	603376	大明电子	111	2,750.58	0.00
175	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
176	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
177	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
178	603214	爱婴室	200	2,422.00	0.00
179	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
180	000630	铜陵有色	300	1,908.00	0.00
181	002568	百润股份	100	1,692.00	0.00
182	600761	安徽合力	100	1,636.00	0.00
183	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
184	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
185	600741	华域汽车	100	1,552.00	0.00
186	300017	网宿科技	100	1,301.00	0.00
187	002327	富安娜	200	1,188.00	0.00

188	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.00
189	603599	广信股份	100	958.00	0.00
190	000998	隆平高科	100	754.00	0.00
191	920076	国亮新材	3	37.02	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	300750	宁德时代	100,984,446.84	5.29
2	002371	北方华创	90,536,091.89	4.75
3	600323	瀚蓝环境	83,048,401.01	4.35
4	000100	TCL 科技	76,361,892.35	4.00
5	002027	分众传媒	67,384,288.00	3.53
6	601799	星宇股份	63,180,616.88	3.31
7	002156	通富微电	61,712,455.11	3.24
8	600547	山东黄金	58,904,368.37	3.09
9	600028	中国石化	57,442,960.30	3.01
10	600115	中国东航	56,980,765.00	2.99
11	601231	环旭电子	55,525,964.01	2.91
12	601318	中国平安	54,461,216.00	2.86
13	300037	新宙邦	53,439,570.65	2.80
14	600885	宏发股份	53,105,984.80	2.78
15	601111	中国国航	50,421,854.03	2.64
16	600309	万华化学	48,908,741.00	2.56
17	001288	运机集团	45,115,430.60	2.37
18	601601	中国太保	44,515,815.99	2.33
19	601633	长城汽车	44,230,432.50	2.32
20	300308	中际旭创	44,206,015.70	2.32
21	002850	科达利	43,888,118.44	2.30
22	600469	风神股份	43,406,188.00	2.28
23	000425	徐工机械	43,297,191.00	2.27
24	300751	迈为股份	42,923,856.00	2.25
25	600031	三一重工	41,205,209.00	2.16
26	000933	神火股份	40,806,876.52	2.14
27	601899	紫金矿业	40,719,787.14	2.14
28	603005	晶方科技	39,774,089.16	2.09
29	600603	广汇物流	39,435,458.04	2.07
30	688256	寒武纪	39,035,040.24	2.05
31	001233	海安集团	38,275,547.20	2.01

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	002371	北方华创	89,425,415.95	4.69
2	601318	中国平安	69,016,673.60	3.62
3	600028	中国石化	68,097,491.26	3.57
4	000100	TCL 科技	67,644,373.80	3.55
5	002156	通富微电	63,652,632.41	3.34
6	300750	宁德时代	59,649,336.23	3.13
7	601231	环旭电子	59,078,723.21	3.10
8	601799	星宇股份	56,181,314.00	2.95
9	601601	中国太保	52,707,203.00	2.76
10	300408	三环集团	52,322,838.00	2.74
11	600309	万华化学	44,474,537.00	2.33
12	000933	神火股份	42,467,123.06	2.23
13	300751	迈为股份	42,310,709.00	2.22
14	603005	晶方科技	40,904,079.68	2.14
15	688072	拓荆科技	40,556,053.43	2.13
16	600031	三一重工	39,912,753.00	2.09
17	601899	紫金矿业	39,255,892.22	2.06
18	600469	风神股份	38,621,682.35	2.03
19	601633	长城汽车	38,279,181.90	2.01
20	688012	中微公司	37,249,361.81	1.95

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	3,782,376,925.62
卖出股票收入（成交）总额	3,285,890,052.87

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	489,719,138.96	11.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,845,204,582.61	44.55
	其中：政策性金融债	504,102,281.63	12.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	351,011,124.40	8.47
7	可转债（可交换债）	7,106,789.36	0.17
8	同业存单	99,730,256.52	2.41
9	其他	-	-
10	合计	2,792,771,891.85	67.42

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	019792	25 国债 19	3,002,000	303,349,797.11	7.32
2	240203	24 国开 03	2,200,000	226,826,328.77	5.48
3	242580003	25 平安银行永续债 01BC	1,300,000	132,901,749.59	3.21
4	242580015	25 招商银行永续债 02BC	1,200,000	121,317,928.77	2.93
5	112696806	26 广州银行 CD092	1,000,000	99,730,256.52	2.41

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，成都银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局四川监管局处罚的情况；广州银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局广东监管局处罚的情况；国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚的情况；平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	1,053,457.02
2	应收清算款	153,890,655.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	417,250.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,361,363.52

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

1	113634	珀莱转债	7,027,459.73	0.17
2	123104	卫宁转债	27,763.79	0.00
3	123216	科顺转债	10,209.24	0.00
4	128135	洽洽转债	6,860.61	0.00
5	113688	国检转债	5,366.21	0.00
6	113692	保隆转债	5,011.99	0.00
7	113673	岱美转债	3,876.65	0.00
8	123107	温氏转债	3,330.66	0.00
9	113691	和邦转债	2,836.99	0.00
10	113682	益丰转债	2,462.02	0.00
11	123247	万凯转债	2,251.80	0.00
12	123091	长海转债	2,150.03	0.00
13	113043	财通转债	1,301.82	0.00
14	113671	武进转债	1,252.90	0.00
15	127085	韵达转债	1,198.06	0.00
16	113655	欧 22 转债	1,168.45	0.00
17	127031	洋丰转债	1,165.50	0.00
18	113616	韦尔转债	1,122.91	0.00

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
创金合信鑫 祥混合 A	7,725	139,284.33	241,337,976 .98	22.43%	834,633,452 .98	77.57%
创金合信鑫 祥混合 C	25,796	88,016.11	393,070,028 .35	17.31%	1,877,393,4 85.40	82.69%
合计	33,262	100,608.35	634,408,005 .33	18.96%	2,712,026,9 38.38	81.04%

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	33.04%

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	创金合信鑫祥混合 A	817,419.86	0.08%
	创金合信鑫祥混合 C	48,009.41	0.00%
	合计	865,429.27	0.03%

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	创金合信鑫祥混合 A	0~10
	创金合信鑫祥混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信鑫祥混合 A	10~50
	创金合信鑫祥混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信鑫祥混合 A	创金合信鑫祥混合 C
基金合同生效日(2021 年 2 月 4 日)基金份额总额	174,020.14	206,571,709.72
本报告期期初基金份额总额	359,984,800.40	1,163,586,363.53
本报告期基金总申购份额	1,073,663,714.35	2,980,562,002.2

		2
减：本报告期基金总赎回份额	357,677,084.79	1,873,684,852.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,075,971,429.96	2,270,463,513.75

§ 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，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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	
广发证券	2	4,208,084,139.36	59.55%	1,918,458.47	59.72%	-
长江证券	2	2,735,018,988.94	38.71%	1,246,885.40	38.81%	-
第一创业证券	4	122,805,924.07	1.74%	47,276.90	1.47%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	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
广发证券	283,481,662.61	78.80%	32,244,141,000.00	70.47%	-	-
长江证券	76,284,059.89	21.20%	13,510,264,000.00	29.53%	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

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	创金合信鑫祥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	创金合信鑫祥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	创金合信鑫祥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	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
5	创金合信鑫祥混合型证券投资基金基金合同（2026 年 6 月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
6	创金合信鑫祥混合型证券投资基金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-27
7	创金合信鑫祥混合型证券投资基金（A 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	2026-06-27
8	创金合信鑫祥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	2026-06-27

§ 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

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫祥混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫祥混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫祥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