

# 创金合信沪港深研究精选灵活配置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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 1  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1  |
| 1.2 目录.....                                  | 2  |
| §2 基金简介.....                                 | 4  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 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.....                        | 7  |
| 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.....                 | 8  |
| 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.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 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.....       | 11 |
| §5 托管人报告.....                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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.....       | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                      | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| §7 投资组合报告.....                               | 36 |
| 7.1 报告期末基金资产组合情况.....                        | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37 |
| 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.....     | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 38 |
| 7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 41 |
| 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.....    | 42 |
| 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 42 |

|                                             |    |
|---------------------------------------------|----|
| 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 ..... | 42 |
| 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 .....  | 42 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 42 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 42 |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 42 |
| §8 基金份额持有人信息 .....                          | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 43 |
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                         | 44 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44 |
| 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 .....      | 44 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                          | 44 |
| §10 重大事件揭示 .....                            | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 44 |
| 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 .....      | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 45 |
| 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 .....      | 45 |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 49 |
| 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 .....    | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 49 |
| §12 备查文件目录 .....                            | 49 |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 49 |
| 12.2 存放地点 .....                             | 49 |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 49 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 创金沪港深精选混合                |
| 基金主代码      | 001662                   |
| 交易代码       | 001662                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                   |
| 基金合同生效日    | 2015 年 8 月 24 日          |
| 基金管理人      | 创金合信基金管理有限公司             |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额 | 37,361,803.35 份          |
| 基金合同存续期    | 不定期                      |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。                 |
| 投资策略   | 本基金采取灵活的资产配置体系，通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类别资产的风险收益特征水平进行综合分析，并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标，灵活动态地调整固定收益类资产和权益类资产的比例，以规避或控制市场系统性风险，从而实现长期稳健增长的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×40%                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、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 | 中国工商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 奚胜田                      |
|         | 联系电话         | 0755-82820166            |
|         | 电子邮箱         | xishengtian@cjhxfund.com |
| 客户服务电话  | 400-868-0666 | 95588                    |

|       |                                            |                   |
|-------|--------------------------------------------|-------------------|
| 传真    | 0755-25832571                              | (010) 66105798    |
| 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          | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码  | 518052                                     | 100140            |
| 法定代表人 | 青美平措                                       | 廖林                |

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

|               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 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       | -523,310.73                           |
| 本期利润          | 3,126,935.19                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0757                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 6.27%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.93%                                 |
| 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      | 8,251,792.08                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2209                                |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末基金资产净值     | 46,730,703.26         |
| 期末基金份额净值     | 1.251                 |
| 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  | 25.10%                |

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

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 10.51%       | 1.79%               | 3.28%              | 0.67%                     | 7.23%   | 1.12% |
| 过去六个月          | 5.93%        | 1.49%               | 1.14%              | 0.64%                     | 4.79%   | 0.85% |
| 过去一年           | 17.69%       | 1.31%               | 8.74%              | 0.58%                     | 8.95%   | 0.73% |
| 过去三年           | -6.08%       | 1.51%               | 19.33%             | 0.65%                     | -25.41% | 0.86% |
| 过去五年           | -36.04%      | 1.62%               | -0.47%             | 0.68%                     | -35.57% | 0.94% |
| 过去七年           | 21.57%       | 1.60%               | 15.10%             | 0.69%                     | 6.47%   | 0.91% |
| 过去十年           | 39.62%       | 1.43%               | 34.13%             | 0.66%                     | 5.49%   | 0.77% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 25.10%       | 1.43%               | 28.16%             | 0.69%                     | -3.06%  | 0.74% |

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

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准  
收益率历史走势对比图  
(2015年08月24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<br>（助理）期限 |      | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                               |
|----|----------------------------------------|---------------------|------|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                        | 任职日期                | 离任日期 |                |                                                                                                                  |
| 刘扬 | 本基金<br>基金经<br>理、风<br>格与行<br>业投资<br>研究部 | 2025 年 9<br>月 3 日   | -    | 12             | 刘扬先生，中国国籍，中国科学院遥感应用研究所硕士。2014 年 3 月加入长城证券有限责任公司，任金融研究所高级研究员，2015 年 3 月加入前海人寿保险股份有限公司，历任资产管理中心研究发展部行业研究员、权益投资部投资经 |

|    |              |                |                 |    |                                                                                                                 |
|----|--------------|----------------|-----------------|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 负责人          |                |                 |    | 理、境外投资部权益投资经理，2021 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部研究员，现任风格与行业投资研究部负责人、基金经理。                                       |
| 李葵 | 本基金基金经理（已离任） | 2025 年 1 月 3 日 | 2026 年 1 月 14 日 | 14 | 李葵女士，中国国籍，上海交通大学硕士。2012 年 4 月加入兴业证券股份有限公司，任研究所地产行业研究员，2015 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部研究员、基金经理助理、基金经理、现任研究员、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，李葵 离任产品情况如下：
- （1）产品类型：私募资产管理计划，离任数量：6 只，离任时间：2026-03-09、2026-05-19；
  - （2）产品类型：公募基金，离任数量：1 只，离任时间：2026-01-14。

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

1 月普遍看好成长风格，同时对春季躁动保持乐观，多条主线各自发力，均衡配置。大科技和有色化工为主，合计配置比例为约 40%；制造业（机器人+锂电+储能+军工）配置比例 15%；恒生科技和港股红利配置比例各 10%，少量消费与地产。

2 月份依然看好大科技，周期分化，结构性看好铝镍稀土煤炭，黄金铜和化工稍减；消费板块略微提升配置，其他板块维持不变。

3 月份，判断春季躁动结束，地缘冲突风险会持续，市场避险情绪会反复震荡；因此减仓科技，加仓周期有色化工，减仓恒科，增加港股红利；维持中游制造和金融地产不变。

展望下一季度：A 股有望随着地缘冲突发展而反弹。乐观情景，4 月地缘缓和直接反弹；中性情景，冲突突然加剧导致急促下跌后反弹。反弹中流动性敏感品种受益，震荡或下跌中红利资产更稳健；总体上均衡偏积极的配置。且地缘冲突下，中国资产和中国经济体的韧性进一步得到证明，人民币地位进一步提升，产业基本面更加支持慢牛延续。

二季度 A 股随着地缘冲突变化和 AI 应用的发展而反弹。在 4 月初，我们认为反弹将至，科技占优，波动也会加大。综合考虑各种情景下的投资配置，反弹中流动性敏感品种受益，震荡或下跌中红利资产更稳健；总体上均衡偏积极的配置。且地缘冲突下，中国资产和中国经济体的韧性进一步得到证明，人民币地位进一步提升，产业基本面更加支持慢牛延续。

5 月份，从北美 AI 链基建投资增速上修、大模型公司 agent 调用 tokens 使用量指数性上涨叠加付费意愿提升、国产 AI 芯片和大模型进步等因素下，我们判断科技板块投资机会更大；本基金策略，从广谱均衡逐渐向科技成长倾斜，努力做到积极均衡型配置，策略偏进攻。

6 月份，科技成长结构性上涨，对其他板块形成虹吸效应；我们一方面积极拥抱科技与 AI，一方面逐渐减仓与调仓，在季度末重新回归均衡配置，但持股集中度大幅上升。配置上，侧重国产科技，特别是国产品圆厂、AI 芯片和国产大模型；并用非银、医药和机械等板块资产，做好产品的均衡性。

综合而言，沪港深精选混合基金在今年进行了比较重要的策略调整：将本产品的投资方向聚焦到中国科技发展和社会经济进步过程中，更具有成长性或确定性的方向上，多个方向均衡布局，享受产业进步和时代发展的红利，兼顾均衡积极的投资风格。我们认为，今年是中国各个优势产业继续崛起的关键期；对应国产替代、产业升级、优势出海和周期底部反转等重要的时代与产业特征，我们积极均衡地配置在优势行业之中，希望可以给投资人更持久、更稳健的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金沪港深精选混合基金份额净值为 1.251 元，本报告期内，份额净值增长率为 5.93%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，全球经济处于地缘冲突、能源冲击与科技革命的三重交织点，宏观叙事正式转向“再通胀下的 AI 驱动”。整体呈现“低增长、高波动、K 型分化”特征，资产定价逻辑由估值扩张切向盈利兑现与供给约束溢价。中国凭借出口与制造业韧性展现超预期抗冲击能力，形成“外需托底+AI 驱动”的结构性修复；海外美日欧央行集体步入鹰派紧缩或选择性再加息阶段；中东战局通过能源与航运重塑全球成本端通胀。AI 产业成为跨周期关键增量，北美基建狂潮受硬约束掣肘，中国 AI 科技崛起与算力投资加速则构成产业升级与出口结构优化的核心抓手。

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

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

动中受输入性通胀冲击小于欧日，为全球宏观下的相对韧性资产，中国资产逻辑正从“低估值修复”向“盈利上修+国产替代”切换。

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

市场策略上，大类资产配置紧扣“再通胀+AI 驱动+供给约束”。权益资产维持超配，采取哑铃型或结构优选策略，一端布局 AI 硬科技基建（光通信、半导体设备、国产芯片、电力设备及液冷），另一端配置受益于物价回升与地缘溢价的上游资源（铜、铝、能源）；A 股因“AI 基建含量”与制造韧性优于港股，港股科技龙头具重估潜力，坚持“结构优于总量”，把握算力链、高端制造、能源电力装备景气，警惕中欧贸易摩擦与地缘外溢。债券资产偏谨慎，美债收益率中枢易升难降，国内债市受供给、通胀及海外溢出约束区间震荡。综合来看：下半年波动加剧系常态，唯有聚焦业绩确定性强的 AI 算力链、高端制造、能源装备及供给受限资源品，方能在全球再通胀与科技裂变中把握超额收益，国内“名义修复+外需强 $\alpha$ +AI 崛起”的三角支撑或帮助中国市场从科技牛市逐渐走向均衡慢牛。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：创金合信沪港深研究精选灵活配置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 | 5,419,653.70        | 4,772,428.41          |
| 结算备付金 |         | 4,659,439.30        | 2,937,262.52          |

|           |         |                     |                       |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 存出保证金     |         | 40,611.35           | 19,789.17             |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 43,885,134.78       | 48,050,522.82         |
| 其中：股票投资   |         | 41,469,578.18       | 45,219,288.63         |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | 2,415,556.60        | 2,831,234.19          |
| 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     |         | 586,917.83          | 175,831.76            |
| 应收股利      |         | 19,022.81           | -                     |
| 应收申购款     |         | 4,957.89            | 2,499.31              |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 54,615,737.66       | 55,958,333.99         |
| 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     |         | 7,563,844.68        | 494,547.15            |
| 应付赎回款     |         | 136,479.93          | 5,192.41              |
| 应付管理人报酬   |         | 44,883.81           | 56,840.19             |
| 应付托管费     |         | 7,480.62            | 9,473.38              |
| 应付销售服务费   |         | -                   | -                     |
| 应付投资顾问费   |         | -                   | -                     |
| 应交税费      |         | 45.70               | -                     |
| 应付利润      |         | -                   | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                   | -                     |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 132,299.66          | 182,660.63            |
| 负债合计      |         | 7,885,034.40        | 748,713.76            |
| 净资产：      |         |                     |                       |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 37,361,803.35       | 46,757,264.57         |
| 其他综合收益    |         | -                   | -                     |

|          |         |               |               |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 9,368,899.91  | 8,452,355.66  |
| 净资产合计    |         | 46,730,703.26 | 55,209,620.23 |
| 负债和净资产总计 |         | 54,615,737.66 | 55,958,333.99 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.251 元，基金份额总额 37,361,803.35 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年<br>1 月 1 日至 2025 年 6 月<br>30 日 |
|-----------------------|----------|---------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | 3,507,399.50                          | -550,921.00                                   |
| 1.利息收入                |          | 15,543.24                             | 4,666.40                                      |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 15,543.24                             | 4,666.40                                      |
| 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）      |          | -174,515.36                           | 1,863,057.31                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -274,758.76                           | 1,293,001.26                                  |
| 基金投资收益                |          | -                                     | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.12 | 4,054.85                              | 7,953.39                                      |
| 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 | 96,188.55                             | 562,102.66                                    |
| 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 | 3,650,245.92                          | -2,420,769.95                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                     | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”         | 6.4.7.18 | 16,125.70                             | 2,125.24                                      |

|                     |            |              |             |
|---------------------|------------|--------------|-------------|
| 号填列)                |            |              |             |
| 减：二、营业总支出           |            | 380,464.31   | 401,587.90  |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 297,365.18   | 305,263.67  |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -            | -           |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 49,560.87    | 50,877.25   |
| 3.销售服务费             |            | -            | -           |
| 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             |            | 4.90         | -           |
| 8.其他费用              | 6.4.7.21   | 33,533.36    | 45,446.98   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 3,126,935.19 | -952,508.90 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 3,126,935.19 | -952,508.90 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -            | -           |
| 六、综合收益总额            |            | 3,126,935.19 | -952,508.90 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置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            | 46,757,264.57                      | -      | 8,452,355.66 | 55,209,620.23 |
| 加：会计政策变更             | -                                  | -      | -            | -             |
| 前期差错更正               | -                                  | -      | -            | -             |
| 其他                   | -                                  | -      | -            | -             |
| 二、本期期初净资产            | 46,757,264.57                      | -      | 8,452,355.66 | 55,209,620.23 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -9,395,461.22                      | -      | 916,544.25   | -8,478,916.97 |
| （一）、综合收益总额           | -                                  | -      | 3,126,935.19 | 3,126,935.19  |

|                                          |                                         |        |               |                |
|------------------------------------------|-----------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -9,395,461.22                           | -      | -2,210,390.94 | -11,605,852.16 |
| 其中: 1.基金申购款                              | 1,077,661.67                            | -      | 227,870.38    | 1,305,532.05   |
| 2.基金赎回款                                  | -10,473,122.89                          | -      | -2,438,261.32 | -12,911,384.21 |
| (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                                | 37,361,803.35                           | -      | 9,368,899.91  | 46,730,703.26  |
| 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                                | 49,310,546.26                           | -      | 4,096,779.46  | 53,407,325.72  |
| 加: 会计政策变更                                | -                                       | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                       | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 49,310,546.26                           | -      | 4,096,779.46  | 53,407,325.72  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -1,674,665.79                           | -      | -1,083,593.54 | -2,758,259.33  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                       | -      | -952,508.90   | -952,508.90    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -1,674,665.79                           | -      | -131,084.64   | -1,805,750.43  |
| 其中: 1.基金申购款                              | 1,600,789.25                            | -      | 93,641.92     | 1,694,431.17   |
| 2.基金赎回款                                  | -3,275,455.04                           | -      | -224,726.56   | -3,500,181.60  |

|                                          |               |   |              |               |
|------------------------------------------|---------------|---|--------------|---------------|
| 回款                                       |               |   |              |               |
| (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                                | 47,635,880.47 | - | 3,013,185.92 | 50,649,066.39 |

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

创金合信沪港深研究精选灵活配置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”)证监许可[2015]第 1477 号《关于准予创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 303,724,280.18 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 987 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 303,868,723.06 份基金份额，其中认购资金利息折合 144,442.88 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、股指期货、债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：

(1) 股票资产占基金资产的 0-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产

的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；(2) 债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-100%。其中，本基金每个交易日日终在扣除股指期货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 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数(全价)收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 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

### （1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

### （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

### （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### （4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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           | 5,419,653.70        |
| 等于：本金          | 5,419,211.78        |
| 加：应计利息         | 441.92              |
| 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     | 5,419,653.70 |

#### 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            |       | 37,674,019.65       | -         | 41,469,578.18 | 3,795,558.53 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -         | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 2,402,084.00        | 13,396.60 | 2,415,556.60  | 76.00        |
|               | 银行间市场 | -                   | -         | -             | -            |
|               | 合计    | 2,402,084.00        | 13,396.60 | 2,415,556.60  | 76.00        |
| 资产支持证券        |       | -                   | -         | -             | -            |
| 基金            |       | -                   | -         | -             | -            |
| 其他            |       | -                   | -         | -             | -            |
| 合计            |       | 40,076,103.65       | 13,396.60 | 43,885,134.78 | 3,795,634.53 |

#### 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     | 9.25       |
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 应付交易费用    | 100,109.03 |
| 其中：交易所市场  | 100,109.03 |
| 银行间市场     | -          |
| 应付利息      | -          |
| 预提费用      | 32,181.38  |
| 合计        | 132,299.66 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额           |
| 上年度末          | 46,757,264.57                      | 46,757,264.57  |
| 本期申购          | 1,077,661.67                       | 1,077,661.67   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,473,122.89                     | -10,473,122.89 |
| 基金份额折算变动份额    | -                                  | -              |
| 本期末           | 37,361,803.35                      | 37,361,803.35  |

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

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 11,630,439.42 | -3,178,083.76 | 8,452,355.66  |
| 加：会计政策变更       | -             | -             | -             |
| 前期差错更正         | -             | -             | -             |
| 其他             | -             | -             | -             |
| 本期期初           | 11,630,439.42 | -3,178,083.76 | 8,452,355.66  |
| 本期利润           | -523,310.73   | 3,650,245.92  | 3,126,935.19  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,855,336.61 | 644,945.67    | -2,210,390.94 |
| 其中：基金申购款       | 310,754.27    | -82,883.89    | 227,870.38    |
| 基金赎回款          | -3,166,090.88 | 727,829.56    | -2,438,261.32 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 8,251,792.08  | 1,117,107.83  | 9,368,899.91  |

#### 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  | 14,401.70                          |
| 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 | 1,079.92                           |

|    |           |
|----|-----------|
| 其他 | 61.62     |
| 合计 | 15,543.24 |

#### 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 | -274,758.76                        |
| 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               | -274,758.76                        |

##### 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   | 154,646,704.77                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 154,628,065.56                     |
| 减：交易费用     | 293,397.97                         |
| 买卖股票差价收入   | -274,758.76                        |

#### 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                 | 2,608.85                           |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,446.00                           |
| 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                           | 4,054.85                           |

##### 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   | 2,832,480.00                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,798,554.00                       |

|          |           |
|----------|-----------|
| 减：应计利息总额 | 32,480.00 |
| 减：交易费用   | -         |
| 买卖债券差价收入 | 1,446.00  |

#### 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   | 96,188.55                          |
| 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            | 96,188.55                          |

#### 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              | 3,650,245.92                       |
| ——股票投资                 | 3,651,615.92                       |
| ——债券投资                 | -1,370.00                          |
| ——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                     | 3,650,245.92                       |

#### 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 | 16,053.06                          |
| 转换费收入   | 72.64                              |
| 合计      | 16,125.70                          |

#### 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    | 4,164.80                           |
| 信息披露费   | 28,016.58                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 汇划手续费   | 1,351.98                           |
| 合计      | 33,533.36                          |

#### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司       | 基金托管人、基金代销机构        |
| 第一创业证券股份有限公司       | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东            |

|                    |          |
|--------------------|----------|
| 深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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 | 3,265,687.66                       | 1.08%        | 754,523.89                              | 0.49%        |

###### 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 | 1,257.23                                | 0.90%      | 1,257.23 | 1.26%        |
| 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      | 290.50                                  | 0.41%      | 0.00     | 0.00%        |

|       |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|
| 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   | 297,365.18                         | 305,263.67                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 143,911.79                         | 146,654.74                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 153,453.39                         | 158,608.93                              |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

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 | 49,560.87                          | 50,877.25                               |

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

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   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 5,419,653.70                       | 14,401.70 | 3,328,321.12                            | 4,108.50 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 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

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

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

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

**6.4.13.2.1 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    | 2,415,556.60        | 2,831,234.19          |
| 合计     | 2,415,556.60        | 2,831,234.19          |

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**

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上市公司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<br>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                        | 5,419,653.70  | -     | -     | -             | 5,419,653.70  |
| 结算备付金                       | 4,659,439.30  | -     | -     | -             | 4,659,439.30  |
| 存出保证金                       | 40,611.35     | -     | -     | -             | 40,611.35     |
| 交易性金融资产                     | 2,415,556.60  | -     | -     | 41,469,578.18 | 43,885,134.78 |
| 应收股利                        | -             | -     | -     | 19,022.81     | 19,022.81     |
| 应收申购款                       | -             | -     | -     | 4,957.89      | 4,957.89      |
| 应收清算款                       | -             | -     | -     | 586,917.83    | 586,917.83    |
| 资产总计                        | 12,535,260.95 | -     | -     | 42,080,476.71 | 54,615,737.66 |
| 负债                          |               |       |       |               |               |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -     | 136,479.93    | 136,479.93    |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -     | 44,883.81     | 44,883.81     |
| 应付托管费                       | -             | -     | -     | 7,480.62      | 7,480.62      |
| 应交税费                        | -             | -     | -     | 45.70         | 45.70         |
| 应付清算款                       | -             | -     | -     | 7,563,844.68  | 7,563,844.68  |
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 132,299.66    | 132,299.66    |
| 负债总计                        | -             | -     | -     | 7,885,034.40  | 7,885,034.40  |
| 利率敏感度缺口                     | 12,535,260.95 | -     | -     | 34,195,442.31 | 46,730,703.26 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |

|         |               |   |   |               |               |
|---------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 资产      |               |   |   |               |               |
| 货币资金    | 4,772,428.41  | - | - | -             | 4,772,428.41  |
| 结算备付金   | 2,937,262.52  | - | - | -             | 2,937,262.52  |
| 存出保证金   | 19,789.17     | - | - | -             | 19,789.17     |
| 交易性金融资产 | 2,831,234.19  | - | - | 45,219,288.63 | 48,050,522.82 |
| 应收申购款   | -             | - | - | 2,499.31      | 2,499.31      |
| 应收清算款   | -             | - | - | 175,831.76    | 175,831.76    |
| 资产总计    | 10,560,714.29 | - | - | 45,397,619.70 | 55,958,333.99 |
| 负债      |               |   |   |               |               |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 5,192.41      | 5,192.41      |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 56,840.19     | 56,840.19     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 9,473.38      | 9,473.38      |
| 应付清算款   | -             | - | - | 494,547.15    | 494,547.15    |
| 其他负债    | -             | - | - | 182,660.63    | 182,660.63    |
| 负债总计    | -             | - | - | 748,713.76    | 748,713.76    |
| 利率敏感度缺口 | 10,560,714.29 | - | - | 44,648,905.94 | 55,209,620.23 |

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  | -3,255.47                   | -287.19                |
|    | 2.市场利率平行下降 25 个基点  | 3,261.70                    | 287.56                 |

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       | - | 10,998,882.93 | - | - | - | 10,998,882.93 |
| 应收股利          | - | 19,022.81     | - | - | - | 19,022.81     |
| 资产合计          | - | 11,017,905.74 | - | - | - | 11,017,905.74 |
| 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 | - | 11,017,905.74 | - | - | - | 11,017,905.74 |

| 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       | -                     | 14,168,066.99 | -       | -       | -         | 14,168,066.99 |
| 资产合计          | -                     | 14,168,066.99 | -       | -       | -         | 14,168,066.99 |
| 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 | -                     | 14,168,066.99 | -       | -       | -         | 14,168,066.99 |

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% | 550,895.29                  | 708,403.35             |
|    | 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -550,895.29                 | -708,403.35            |

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  | 41,469,578.18       | 88.74         | 45,219,288.63         | 81.90         |
| 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            | 41,469,578.18       | 88.74         | 45,219,288.63         | 81.90         |

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%        | 3,699,708.42                | 4,211,724.54             |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -3,699,708.42               | -4,211,724.54            |

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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          | 41,469,578.18       |
| 第二层次          | 2,415,556.60        |
| 第三层次          | -                   |
| 合计            | 43,885,134.78       |

##### 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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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<br>(%) |
|----|-------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资  | 41,469,578.18 | 75.93            |
|    | 其中：股票 | 41,469,578.18 | 75.93            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 2,415,556.60  | 4.42   |
|   | 其中：债券             | 2,415,556.60  | 4.42   |
|   | 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      | 10,079,093.00 | 18.45  |
| 8 | 其他各项资产            | 651,509.88    | 1.19   |
| 9 | 合计                | 54,615,737.66 | 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 10,998,882.93 元，占净值比为 23.54%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 20,480,818.46 | 43.83        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 6,679,335.79  | 14.29        |
| J  | 金融业              | 3,310,541.00  | 7.08         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 30,470,695.25 | 65.20        |

### 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（%） |
|------|---------------|--------------|
| 医疗保健 | 5,988,217.98  | 12.81        |
| 信息技术 | 5,010,664.95  | 10.72        |
| 合计   | 10,998,882.93 | 23.54        |

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  | 688347 | 华虹宏力   | 9,903   | 3,330,378.90 | 7.13         |
| 2  | H02513 | 智谱     | 1,800   | 3,289,372.56 | 7.04         |
| 3  | 688536 | 思瑞浦    | 7,411   | 2,698,270.99 | 5.77         |
| 4  | 300433 | 蓝思科技   | 44,700  | 2,398,602.00 | 5.13         |
| 5  | 688126 | 沪硅产业   | 59,820  | 2,386,219.80 | 5.11         |
| 6  | 688233 | 神工股份   | 10,795  | 2,314,663.90 | 4.95         |
| 7  | 688031 | 星环科技   | 19,985  | 2,301,872.30 | 4.93         |
| 8  | H06990 | 科伦博泰生物 | 4,500   | 1,704,876.80 | 3.65         |
| 9  | 688777 | 中控技术   | 14,291  | 1,679,192.50 | 3.59         |
| 10 | 300661 | 圣邦股份   | 11,100  | 1,592,628.00 | 3.41         |
| 11 | H09926 | 康方生物   | 20,000  | 1,529,516.55 | 3.27         |
| 12 | H02162 | 康诺亚－B  | 24,000  | 1,474,797.90 | 3.16         |
| 13 | H01801 | 信达生物   | 18,500  | 1,279,026.73 | 2.74         |
| 14 | 600999 | 招商证券   | 59,400  | 1,253,340.00 | 2.68         |
| 15 | 300408 | 三环集团   | 7,100   | 1,184,990.00 | 2.54         |
| 16 | 688266 | 泽璟制药   | 10,000  | 1,166,600.00 | 2.50         |
| 17 | 920438 | 戈碧迦    | 7,113   | 1,129,971.18 | 2.42         |
| 18 | 002409 | 雅克科技   | 5,000   | 1,122,500.00 | 2.40         |
| 19 | 688729 | 屹唐股份   | 26,000  | 1,118,000.00 | 2.39         |
| 20 | 688786 | 悦安新材   | 23,181  | 1,068,180.48 | 2.29         |
| 21 | 300059 | 东方财富   | 50,600  | 1,031,228.00 | 2.21         |
| 22 | 002736 | 国信证券   | 102,700 | 1,025,973.00 | 2.20         |
| 23 | H09903 | 天数智芯   | 1,500   | 995,358.30   | 2.13         |
| 24 | 688802 | 沐曦股份   | 1,054   | 873,028.20   | 1.87         |
| 25 | H00522 | ASMPT  | 3,500   | 725,934.09   | 1.55         |
| 26 | 600176 | 中国巨石   | 5,600   | 408,128.00   | 0.87         |
| 27 | 300776 | 帝尔激光   | 1,800   | 386,928.00   | 0.83         |

### 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  | 688126 | 沪硅产业   | 5,525,065.31 | 10.01          |
| 2  | 300433 | 蓝思科技   | 3,919,964.00 | 7.10           |
| 3  | 688347 | 华虹宏力   | 2,362,544.70 | 4.28           |
| 3  | H01347 | 华虹宏力   | 1,083,173.82 | 1.96           |
| 4  | H01060 | 大麦娱乐   | 3,144,355.15 | 5.70           |
| 5  | H02513 | 智谱     | 3,132,178.67 | 5.67           |
| 6  | 300308 | 中际旭创   | 3,117,851.00 | 5.65           |
| 7  | 688256 | 寒武纪    | 3,040,951.70 | 5.51           |
| 8  | 002475 | 立讯精密   | 2,986,609.00 | 5.41           |
| 9  | 688031 | 星环科技   | 2,631,105.16 | 4.77           |
| 10 | 688536 | 思瑞浦    | 2,372,008.42 | 4.30           |
| 11 | 600183 | 生益科技   | 2,370,857.00 | 4.29           |
| 12 | 300502 | 新易盛    | 2,369,938.00 | 4.29           |
| 13 | 688048 | 长光华芯   | 2,346,812.73 | 4.25           |
| 14 | 688702 | 盛科通信   | 2,286,390.67 | 4.14           |
| 15 | 300548 | 长芯博创   | 2,236,168.00 | 4.05           |
| 16 | 688123 | 聚辰股份   | 2,071,746.49 | 3.75           |
| 17 | 688322 | 奥比中光   | 2,062,253.93 | 3.74           |
| 18 | H01787 | 山东黄金   | 2,041,383.95 | 3.70           |
| 19 | 300633 | 开立医疗   | 1,892,203.00 | 3.43           |
| 20 | 002027 | 分众传媒   | 1,821,946.00 | 3.30           |
| 21 | H01378 | 中国宏桥   | 1,803,538.86 | 3.27           |
| 22 | H09988 | 阿里巴巴－W | 1,773,219.94 | 3.21           |
| 23 | H06990 | 科伦博泰生物 | 1,755,708.40 | 3.18           |
| 24 | 600048 | 保利发展   | 1,735,764.00 | 3.14           |
| 25 | H00358 | 江西铜业股份 | 1,729,394.13 | 3.13           |
| 26 | 600176 | 中国巨石   | 1,726,076.00 | 3.13           |
| 27 | 002384 | 东山精密   | 1,719,919.00 | 3.12           |
| 28 | 920438 | 戈碧迦    | 1,677,990.58 | 3.04           |
| 29 | 601100 | 恒立液压   | 1,621,226.00 | 2.94           |
| 30 | 300620 | 光库科技   | 1,610,223.00 | 2.92           |
| 31 | H01024 | 快手－W   | 1,596,317.15 | 2.89           |
| 32 | H09926 | 康方生物   | 1,589,694.86 | 2.88           |
| 33 | 688777 | 中控技术   | 1,545,876.05 | 2.80           |
| 34 | H02162 | 康诺亚－B  | 1,530,778.61 | 2.77           |
| 35 | 001979 | 招商蛇口   | 1,357,449.00 | 2.46           |
| 36 | 600185 | 珠免集团   | 1,305,059.00 | 2.36           |
| 37 | H01801 | 信达生物   | 1,301,383.16 | 2.36           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 38 | 300661 | 圣邦股份 | 1,277,479.00 | 2.31 |
| 39 | 688233 | 神工股份 | 1,214,203.18 | 2.20 |
| 40 | H01818 | 招金矿业 | 1,207,003.14 | 2.19 |
| 41 | 600999 | 招商证券 | 1,205,722.00 | 2.18 |
| 42 | 300776 | 帝尔激光 | 1,163,721.00 | 2.11 |
| 43 | 688266 | 泽璟制药 | 1,146,675.79 | 2.08 |
| 44 | 000951 | 中国重汽 | 1,142,889.00 | 2.07 |
| 45 | 600418 | 江淮汽车 | 1,135,771.00 | 2.06 |
| 46 | 300408 | 三环集团 | 1,135,439.00 | 2.06 |
| 47 | H02601 | 中国太保 | 1,134,028.56 | 2.05 |
| 48 | H02628 | 中国人寿 | 1,108,729.10 | 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  | 300308 | 中际旭创   | 5,236,947.00 | 9.49           |
| 2  | 300548 | 长芯博创   | 3,525,902.00 | 6.39           |
| 3  | 688126 | 沪硅产业   | 3,323,719.49 | 6.02           |
| 4  | 688256 | 寒武纪    | 3,133,160.96 | 5.68           |
| 5  | H01024 | 快手—W   | 3,013,870.06 | 5.46           |
| 6  | 300502 | 新易盛    | 2,880,054.00 | 5.22           |
| 7  | 603259 | 药明康德   | 2,558,585.00 | 4.63           |
| 8  | 002475 | 立讯精密   | 2,552,252.00 | 4.62           |
| 9  | 688192 | 迪哲医药   | 2,534,332.96 | 4.59           |
| 10 | 600183 | 生益科技   | 2,515,395.00 | 4.56           |
| 11 | 688702 | 盛科通信   | 2,513,986.26 | 4.55           |
| 12 | H09988 | 阿里巴巴—W | 2,306,092.19 | 4.18           |
| 13 | H01060 | 大麦娱乐   | 2,250,143.95 | 4.08           |
| 14 | H01787 | 山东黄金   | 2,023,137.42 | 3.66           |
| 15 | 300620 | 光库科技   | 2,014,465.00 | 3.65           |
| 16 | 300433 | 蓝思科技   | 1,988,616.00 | 3.60           |
| 17 | 002384 | 东山精密   | 1,938,602.00 | 3.51           |
| 18 | 600176 | 中国巨石   | 1,887,606.00 | 3.42           |
| 19 | 688261 | 东微半导   | 1,861,344.55 | 3.37           |
| 20 | 688322 | 奥比中光   | 1,829,507.84 | 3.31           |
| 21 | 688123 | 聚辰股份   | 1,829,302.78 | 3.31           |
| 22 | 300750 | 宁德时代   | 1,796,073.00 | 3.25           |
| 23 | 688048 | 长光华芯   | 1,788,092.73 | 3.24           |
| 24 | 688195 | 腾景科技   | 1,767,764.01 | 3.20           |
| 25 | 000807 | 云铝股份   | 1,743,809.00 | 3.16           |
| 26 | 601100 | 恒立液压   | 1,728,429.00 | 3.13           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 27 | 300633 | 开立医疗   | 1,719,493.00 | 3.11 |
| 28 | H01378 | 中国宏桥   | 1,710,499.66 | 3.10 |
| 29 | H00358 | 江西铜业股份 | 1,709,450.00 | 3.10 |
| 30 | H00981 | 中芯国际   | 1,696,473.27 | 3.07 |
| 31 | 002027 | 分众传媒   | 1,586,766.00 | 2.87 |
| 32 | 002602 | 世纪华通   | 1,579,256.00 | 2.86 |
| 33 | 603119 | 浙江荣泰   | 1,559,720.00 | 2.83 |
| 34 | H00941 | 中国移动   | 1,501,232.98 | 2.72 |
| 35 | 600048 | 保利发展   | 1,480,732.00 | 2.68 |
| 36 | 600258 | 首旅酒店   | 1,452,966.00 | 2.63 |
| 37 | H02601 | 中国太保   | 1,441,500.11 | 2.61 |
| 38 | H03690 | 美团-W   | 1,416,574.45 | 2.57 |
| 39 | 688172 | 燕东微    | 1,378,626.20 | 2.50 |
| 40 | 688536 | 思瑞浦    | 1,366,974.32 | 2.48 |
| 41 | 002985 | 北摩高科   | 1,359,553.00 | 2.46 |
| 42 | 600110 | 诺德股份   | 1,330,146.00 | 2.41 |
| 43 | 001979 | 招商蛇口   | 1,297,224.00 | 2.35 |
| 44 | 688072 | 拓荆科技   | 1,288,418.37 | 2.33 |
| 45 | H00700 | 腾讯控股   | 1,258,830.15 | 2.28 |
| 46 | 002353 | 杰瑞股份   | 1,248,748.00 | 2.26 |
| 47 | 601118 | 海南橡胶   | 1,234,311.00 | 2.24 |
| 48 | 000951 | 中国重汽   | 1,195,041.00 | 2.16 |
| 49 | 000426 | 兴业银锡   | 1,183,497.08 | 2.14 |
| 50 | 600185 | 珠免集团   | 1,156,987.00 | 2.10 |
| 51 | H02648 | 安井食品   | 1,154,249.21 | 2.09 |
| 52 | H00883 | 中国海洋石油 | 1,129,459.07 | 2.05 |
| 53 | 600418 | 江淮汽车   | 1,105,462.00 | 2.00 |

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 | 147,226,739.19 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 154,646,704.77 |

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      | 2,415,556.60 | 5.17         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
| 4  | 企业债券      | -            | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -    |
| 6  | 中期票据      | -            | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -    |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 2,415,556.60 | 5.17 |

## 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  | 019827 | 26 国债 01 | 24,000 | 2,415,556.60 | 5.17         |

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 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 | 40,611.35  |
| 2  | 应收清算款 | 586,917.83 |
| 3  | 应收股利  | 19,022.81  |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 4,957.89   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 651,509.88 |

### 7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(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  |
| 7,876        | 4,743.75  | 480.28 | 0.00%  | 37,361,323.07 | 100.00% |

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 | 99.41%                                  |

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               | 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 | 41,771.83 | 0.11%    |

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                             | 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015 年 8 月 24 日)基金份额总额 | 303,868,723.06 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 46,757,264.57  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,077,661.67   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 10,473,122.89  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 37,361,803.35  |

§ 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**

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

**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无受调查或处罚等情况。

**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<br>单元<br>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 |    |
| 中信建投证券 | 2              | 87,021,736.49 | 28.83%       | 40,957.17 | 29.47%     | -  |
| 金融街证券  | 2              | 46,872,631.18 | 15.53%       | 22,239.33 | 16.00%     | -  |
| 联储证券   | 2              | 43,935,731.14 | 14.55%       | 20,029.44 | 14.41%     | -  |

|            |   |               |        |           |        |   |
|------------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 华创证券       | 2 | 34,038,523.34 | 11.28% | 15,518.28 | 11.17% | - |
| 东吴证券       | 2 | 23,532,932.54 | 7.80%  | 8,514.72  | 6.13%  | - |
| 国信证券       | 2 | 16,461,637.98 | 5.45%  | 8,560.06  | 6.16%  | - |
| 兴业证券       | 2 | 14,527,853.19 | 4.81%  | 7,213.39  | 5.19%  | - |
| 银河证券       | 2 | 13,117,922.90 | 4.35%  | 5,979.26  | 4.30%  | - |
| 招商证券       | 2 | 12,217,317.14 | 4.05%  | 5,569.94  | 4.01%  | - |
| 山西证券       | 2 | 6,243,629.08  | 2.07%  | 2,846.37  | 2.05%  | - |
| 第一创业<br>证券 | 4 | 3,265,687.66  | 1.08%  | 1,257.23  | 0.90%  | - |
| 开源证券       | 2 | 637,841.32    | 0.21%  | 290.79    | 0.21%  | - |
| 万联证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 上海证券       | 4 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东兴证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东北证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东方证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 中信证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 中邮证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 中金公司       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 中金财富<br>证券 | 4 | -             | -      | -         | -      | - |
| 五矿证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华安证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华泰证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华福证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国海证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国联民生<br>证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 天风证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 太平洋证<br>券  | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 平安证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 方正证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 江海证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 申万宏源       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 西南证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 西部证券       | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 财通证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 金元证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 长江证券       | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 首创证券       | 1 | -             | -      | -         | -      | - |

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 |
| 中信建投证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 金融街证券  | 2,101,721.00 | 87.50%       | -      | -              | -    | -            |
| 联储证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东吴证券   | 300,363.00   | 12.50%       | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 山西证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 第一创业证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 开源证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 万联证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 上海证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券   | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中邮证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券       | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券       | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券       | - | - | - | - | - | - |

## 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  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告              | 公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-14 |
| 2  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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       | 2026-01-17 |
| 3  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金（2026 年 1 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 | 2026-01-17 |
| 4  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置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 |
| 5  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置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 |

|    |                                               |                          |            |
|----|-----------------------------------------------|--------------------------|------------|
| 6  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置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 |
| 7  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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       | 2026-06-26 |
| 8  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置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 |
| 9  | 创金合信沪港深研究精选灵活配置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 | 2026-06-26 |
| 10 | 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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-26 |

§ 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、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信沪港深研究精选灵活配置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](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日