

# 创金合信中证 500 指数增强型发起式 证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告财务资料已经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2025 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
8.6 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.....	65
8.7 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.....	65
8.8 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.....	65
8.9 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.....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	67
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	67
§10 开放式基金份额变动.....	68
§11 重大事件揭示.....	68
11.1 基金份额持有人大会决议.....	68
11.2 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.....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4 基金投资策略的改变.....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
12.1 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.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§13 备查文件目录.....	73
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点.....	73
13.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证 500 增强	
基金主代码	002311	
交易代码	002311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 31 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	372,618,149.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证 500 增强 A	创金合信中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	002311	002316
报告期末下属分级基金的份 额总额	131,745,740.33 份	240,872,408.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	<p>本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。即，本基金股票投资组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。</p> <p>（1）多因子模型</p> <p>多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子</p>

	<p>的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。</p> <p>(2) 投资组合优化模型</p> <p>在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，根据多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化器，构建风险调整后的最优投资组合。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>4、衍生产品投资策略</p> <p>(1) 权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。</p> <p>(2) 股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>(3) 本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在控制信用风险的基础上，采取分散化投资的方式进行中小企业私募债的投资。基金管理人将紧密跟踪研究发债企业的基本面情况，适时调整投资组合，控制投资风险。</p> <p>6、其他</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
		张姗

	联系电话	0755-82820166	400-61-95555
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	400-61-95555
传真		0755-25832571	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518052	518040
法定代表人		钱龙海	缪建民

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

##### 1、创金合信中证 500 增强 A

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	50,389,679.20	5,743,920.96	-21,759,418.95
本期利润	58,413,166.60	9,754,128.49	-14,782,088.10
加权平均基金份额本期利润	0.3732	0.0516	-0.0665
本期加权平均净值利润率	29.78%	5.07%	-5.82%
本期基金份额净值增长率	34.40%	5.77%	-6.51%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	64,848,447.97	21,491,080.25	11,389,741.39
期末可供分配基金份额利润	0.4922	0.1176	0.0566
期末基金资产净值	197,895,092.90	204,258,728.58	212,741,519.63
期末基金份额净值	1.5021	1.1176	1.0566
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	76.43%	31.27%	24.10%

##### 2、创金合信中证 500 增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	60,063,305.26	5,633,057.38	-20,644,577.57
本期利润	68,231,224.61	11,931,263.35	-14,006,237.03
加权平均基金份额本期利润	0.3960	0.0608	-0.0647
本期加权平均净值利润率	31.37%	5.99%	-5.67%
本期基金份额净值增长率	34.28%	5.67%	-6.61%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	117,240,115.36	21,287,544.35	11,047,808.49
期末可供分配基金份额利润	0.4867	0.1145	0.0547
期末基金资产净值	360,463,369.14	207,186,847.93	212,962,755.19
期末基金份额净值	1.4965	1.1145	1.0547
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	75.77%	30.90%	23.88%

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

创金合信中证 500 增强 A

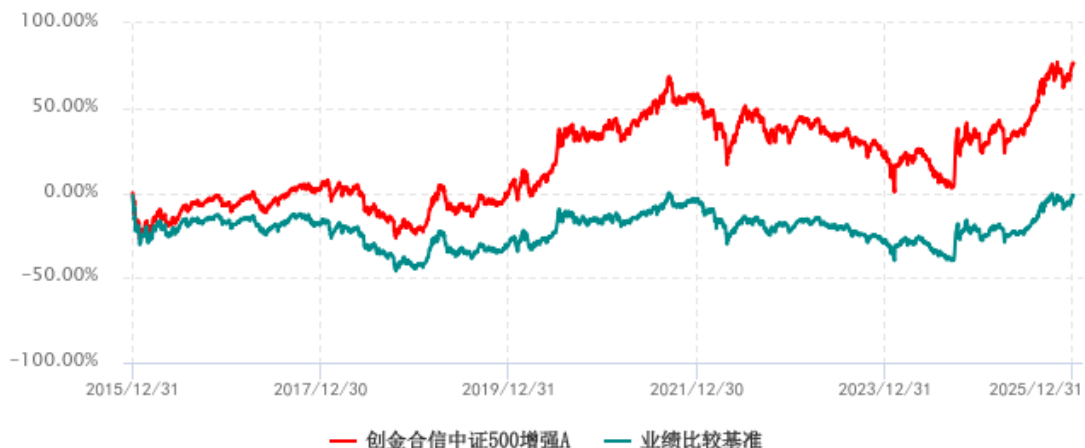
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.24%	1.13%	0.72%	1.18%	1.52%	-0.05%
过去六个月	25.24%	1.06%	24.85%	1.11%	0.39%	-0.05%
过去一年	34.40%	1.20%	28.89%	1.20%	5.51%	0.00%
过去三年	32.91%	1.31%	26.47%	1.30%	6.44%	0.01%
过去五年	29.42%	1.25%	17.34%	1.23%	12.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	76.43%	1.33%	-1.49%	1.34%	77.92%	-0.01%

创金合信中证 500 增强 C

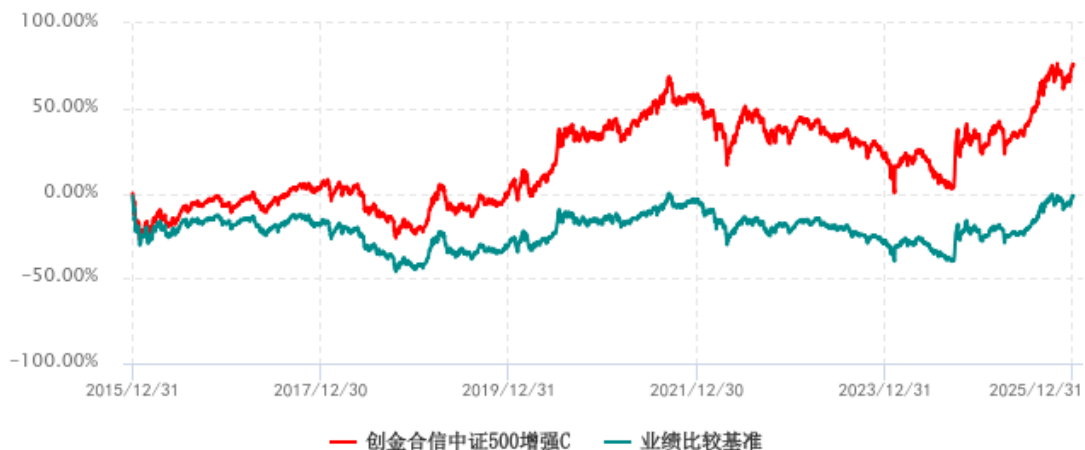
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.22%	1.13%	0.72%	1.18%	1.50%	-0.05%
过去六个月	25.18%	1.06%	24.85%	1.11%	0.33%	-0.05%
过去一年	34.28%	1.20%	28.89%	1.20%	5.39%	0.00%
过去三年	32.52%	1.31%	26.47%	1.30%	6.05%	0.01%
过去五年	28.78%	1.25%	17.34%	1.23%	11.44%	0.02%
自基金合同生效起至今	75.77%	1.33%	-1.49%	1.34%	77.26%	-0.01%

#### 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

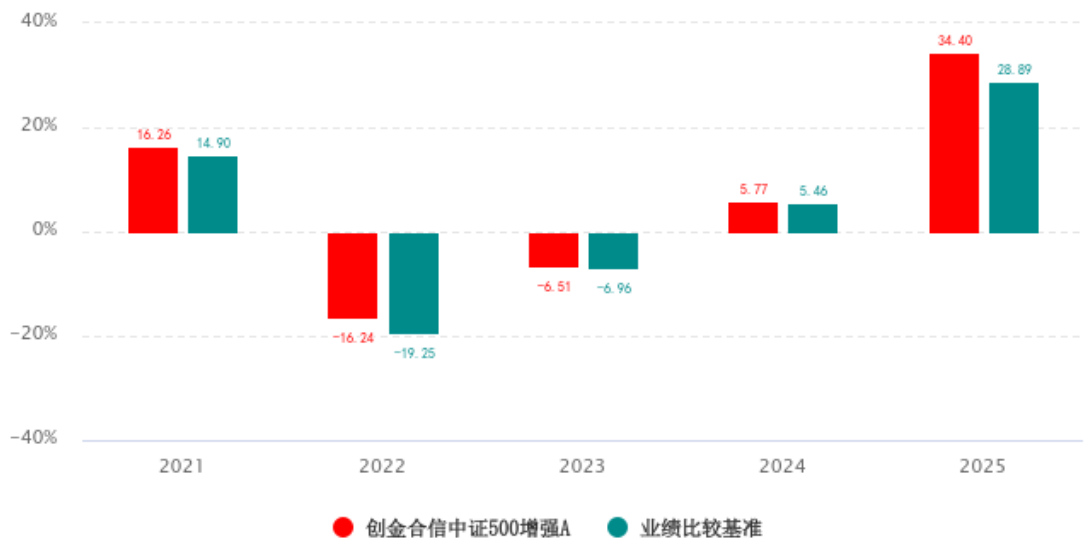
创金合信中证500增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月31日-2025年12月31日)

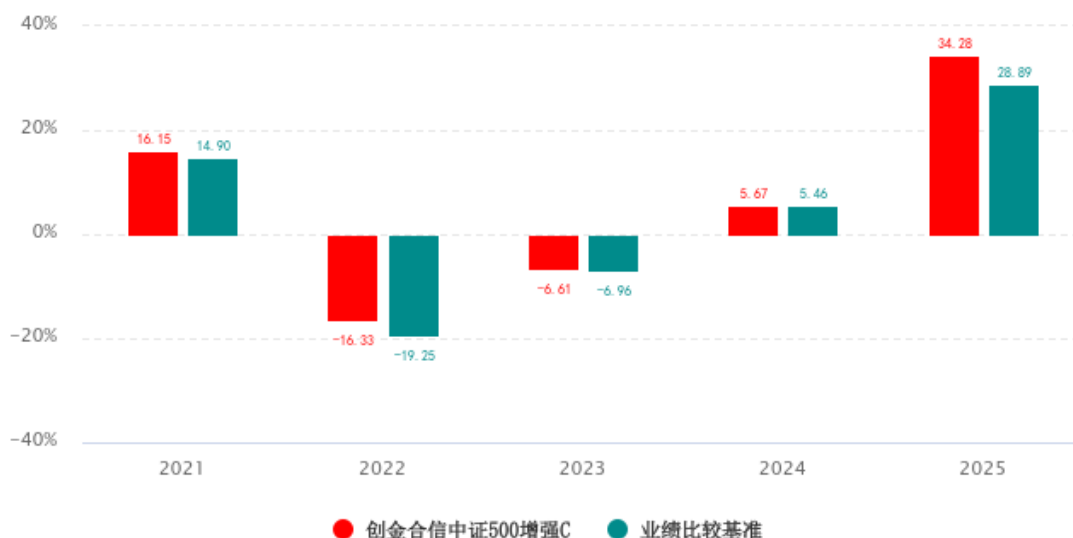


创金合信中证500增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月31日-2025年12月31日)



### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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		
李添峰	本基金基金经理	2023 年 3 月 4 日	-	13	李添峰先生，中国国籍，中国人民大学硕士。2012 年 7 月加入国海证券股份有

	理、量化指数部总监助理				限公司，历任证券资产管理分公司量化投资研究员、产品经理，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、指数策略投资研究部投资经理、组合风险研究与服务部投资风险研究员、量化指数与国际部投资经理，现任量化指数部总监助理、基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人	2019 年 7 月 5 日	-	22	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003 年 12 月加入 UNX Inc 任分析师，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015 年 1 月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数部负责人、基金经理。

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》（下称“管理制度”），该管理制度涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。本报告期内，本公司严格执行该管理制度的要求，实行了如下具体控制措施：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

执行投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立健全客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据，确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立健全不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立健全公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司执行异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，其中 10 日内价差分析仅适用于兼任了私募资产管理计划投资经理的基金经理所管理的多个投资组合，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2025 年 A 股市场整体呈现震荡上行趋势，上证指数 8 月突破十年新高，年内突破 4000 点关口，中证 500 指数全年上涨 30.39%。宏观层面，国际货币体系重构和国内科技创新两大因素成为本年行情的核心驱动力，共同推动中国资产重估。在国际货币体系重构背景下，国际资本出现回流趋势，叠加国内政策鼓励中长期资金入市，机构投资者占比提升，在股市财富效应推动下，居民存款搬家，个人投资者积极入市，市场流动性提升，资金面活跃，增量资金持续入场，对 A 股上行起到支撑。另一方面，科技创新突破为市场注入了新的增长预期，极大提升投资者信心，投资者风险偏好明显抬升。年初，DeepSeek 以低成本、高性能和开源的三大优势引发全球关注，打破美国 AI 垄断叙事，全球投资者重新审视中国科技实力，开启中国资产重估行情，科创成长成为行情主线。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证 500 增强 A 基金份额净值为 1.5021 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 34.40%，同期业绩比较基准收益率为 28.89%；截至本报告期末创金合信中证 500 增强 C 基金份额净值为 1.4965 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 34.28%，同期业绩比较基准收益率为 28.89%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们认为国际货币体系重构与国内科技创新两大因素仍将继续支撑中国资产重估行情。特朗普上台以来一系列超预期的行动，一方面增加了市场的不确定性，另一方面进一步强化国际货币体系重构逻辑。AI 创新经历 3 年高速发展，2026 年有望逐步进入产业应用兑现阶段，我国创新产业有望迎来业绩兑现周期，对估值抬升起到支撑作用。

整体上，预计增量资金仍将持续入场，居民存款搬家、机构中长期资金入市的趋势仍将延续，在经历估值大幅提升之后，基本面重要性进一步上升，防范“波动”将成为 2026 年市场的一大关注点，市场风格可能更趋于均衡。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规的要求，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

合规管理方面，强化合规法务工作，严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，及时发布合规提示或警示，并通过合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等方式对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行；加强合规制度建设，根据法律法规、监管政策要求，持续完善投资、研究、交易以及从业人员投资行为、反洗钱等方面的管理制度。

风险控制方面，健全全面风险管理体系，加强权限管理，完善事前、事中和事后的风险管理体系；加强关联交易管理、内幕交易防控机制，严格履行关联交易决策审批程序，开展关于防范内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；健全公平交易与异常交易管理机制，严格按照法律法规以及公司公平交易与异常交易相关制度的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控。

稽核方面，根据法律法规、监管政策要求，公司每年进行公司内部控制、反洗钱、信息技术管理等方面的稽核评估工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2602251 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见	<p>我们审计了后附的创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法</p>

	按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴钟鸣                      柳育慈
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	13,012,218.35	4,837,340.99
结算备付金		4,919,705.39	7,343,594.10
存出保证金		1,388,424.70	476,514.53
交易性金融资产	7.4.7.2	546,785,740.92	409,812,337.96
其中：股票投资		522,641,017.63	384,334,557.14
基金投资		-	-
债券投资		24,144,723.29	25,477,780.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		19,150,245.53	4,894,101.04
应收股利		-	-
应收申购款		206,343.42	135,306.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		585,462,678.31	427,499,195.41
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		7,999,523.82	13,002,328.79
应付清算款		-	1,959,344.82
应付赎回款		18,546,937.21	539,040.22
应付管理人报酬		297,326.97	286,629.39
应付托管费		37,165.89	35,828.68
应付销售服务费		20,709.33	17,993.00

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	4,449.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	202,553.05	208,004.65
负债合计		27,104,216.27	16,053,618.90
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	372,618,149.12	368,666,951.91
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	185,740,312.92	42,778,624.60
净资产合计		558,358,462.04	411,445,576.51
负债和净资产总计		585,462,678.31	427,499,195.41

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，创金合信中证 500 增强 A 份额净值 1.5021 元，基金份额总额 131,745,740.33 份；创金合信中证 500 增强 C 份额净值 1.4965 元，基金份额总额 240,872,408.79 份；总份额合计 372,618,149.12 份。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		131,014,682.91	25,939,459.70
1.利息收入		106,923.08	135,274.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	106,923.08	135,274.70
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）		114,470,135.30	15,412,227.24
其中：股票投资收益	7.4.7.10	107,259,165.60	7,356,153.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	215,210.24	529,561.11
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,325,517.78	159,359.79

股利收益	7.4.7.15	5,670,241.68	7,367,152.58
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）	7.4.7.16	16,191,406.75	10,308,413.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	246,217.78	83,544.26
减：二、营业总支出		4,370,291.70	4,254,067.86
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,315,550.81	3,136,061.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	414,443.90	392,007.74
3.销售服务费	7.4.10.2.3	218,119.47	199,515.64
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		218,508.94	282,029.64
其中：卖出回购金融资产支出		218,508.94	282,029.64
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		4,847.66	576.38
8.其他费用	7.4.7.19	198,820.92	243,876.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		126,644,391.21	21,685,391.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		126,644,391.21	21,685,391.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		126,644,391.21	21,685,391.84

### 7.3 净资产变动表

会计主体：创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	368,666,951.91	-	42,778,624.60	411,445,576.51
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	368,666,951.91	-	42,778,624.60	411,445,576.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,951,197.21	-	142,961,688.32	146,912,885.53
（一）、综合收益总额	-	-	126,644,391.21	126,644,391.21
（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）	3,951,197.21	-	16,317,297.11	20,268,494.32
其中：1.基金申购款	364,954,284.77	-	131,955,073.14	496,909,357.91
2.基金赎回款	-361,003,087.56	-	-115,637,776.03	-476,640,863.59
（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	372,618,149.12	-	185,740,312.92	558,358,462.04
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	403,266,724.94	-	22,437,549.88	425,704,274.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	403,266,724.94	-	22,437,549.88	425,704,274.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,599,773.03	-	20,341,074.72	-14,258,698.31

(一)、综合收益总额	-	-	21,685,391.84	21,685,391.84
(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)	-34,599,773.03	-	-1,344,317.12	-35,944,090.15
其中: 1.基金申购款	84,830,701.64	-	3,384,804.87	88,215,506.51
2.基金赎回款	-119,430,474.67	-	-4,729,121.99	-124,159,596.66
(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	368,666,951.91	-	42,778,624.60	411,445,576.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(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]3049 号《关于准予创金合信中证 500 指数增强型发起式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《创金合信中证 500 指数增强型发起式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 10,000,000.00 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 1505 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 31 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,000,000.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购、申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取前端认购费、前端申购费，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基金份额净值，计算公式如下：T 日某类基金份额净值 = 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、《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票及存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、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、金融衍生品（包括权证、股指期货等）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）。本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 90%。其中，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率  $\times 95\%$  + 一年期人民币定期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

#### 7.4.2 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，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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。

#### 7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

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

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

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

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金

是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

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

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

##### -以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (a) 金融工具的初始确认

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

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

#### (b) 金融工具的后续计量

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

##### -以摊余成本计量的金融资产

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

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

##### -以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

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

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

#### 核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

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

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

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

##### 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

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

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》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) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税;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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、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。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 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) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	13,012,218.35	4,837,340.99
等于：本金	13,009,583.71	4,836,551.07
加：应计利息	2,634.64	789.92
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	13,012,218.35	4,837,340.99

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		506,792,542.95	-	522,641,017.63	15,848,474.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,986,420.00	139,923.29	24,144,723.29	18,380.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	23,986,420.00	139,923.29	24,144,723.29	18,380.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		530,778,962.95	139,923.29	546,785,740.92	15,866,854.68
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		384,805,652.21	-	384,334,557.14	-471,095.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,073,877.00	457,780.82	25,477,780.82	-53,877.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,073,877.00	457,780.82	25,477,780.82	-53,877.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		409,879,529.21	457,780.82	409,812,337.96	-524,972.07

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,173,620.00	-	-	-
--股指期货	10,173,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,173,620.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,468,480.00	-	-	-
--股指期货	3,468,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,468,480.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2601	IC2601	-7.00	-10,437,280.00	-263,660.00
合计				-263,660.00
减：可抵销期货暂收款				-263,660.00
净额				-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	82.69	113.37
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	43,970.36	31,465.58
其中：交易所市场	43,970.36	31,465.58
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	158,500.00	176,425.70
合计	202,553.05	208,004.65

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信中证 500 增强 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	182,767,648.33	182,767,648.33
本期申购	78,379,093.44	78,379,093.44
本期赎回（以“-”号填列）	-129,401,001.44	-129,401,001.44
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	131,745,740.33	131,745,740.33

创金合信中证 500 增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	185,899,303.58	185,899,303.58
本期申购	286,575,191.33	286,575,191.33
本期赎回（以“-”号填列）	-231,602,086.12	-231,602,086.12
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	240,872,408.79	240,872,408.79

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信中证 500 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,005,070.29	-6,513,990.04	21,491,080.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	28,005,070.29	-6,513,990.04	21,491,080.25
本期利润	50,389,679.20	8,023,487.40	58,413,166.60
本期基金份额交易产生的变动数	-13,546,301.52	-208,592.76	-13,754,894.28
其中：基金申购款	21,132,086.45	-2,027,627.61	19,104,458.84
基金赎回款	-34,678,387.97	1,819,034.85	-32,859,353.12
本期已分配利润	-	-	-

本期末	64,848,447.97	1,300,904.60	66,149,352.57
-----	---------------	--------------	---------------

创金合信中证 500 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,905,766.61	-6,618,222.26	21,287,544.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	27,905,766.61	-6,618,222.26	21,287,544.35
本期利润	60,063,305.26	8,167,919.35	68,231,224.61
本期基金份额交易产生的变动数	29,271,043.49	801,147.90	30,072,191.39
其中：基金申购款	109,225,476.46	3,625,137.84	112,850,614.30
基金赎回款	-79,954,432.97	-2,823,989.94	-82,778,422.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,240,115.36	2,350,844.99	119,590,960.35

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,192.68	25,622.93
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	69,531.16	107,953.12
其他	4,199.24	1,698.65
合计	106,923.08	135,274.70

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	107,259,165.60	7,356,153.76
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	107,259,165.60	7,356,153.76

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,897,141,701.40	2,234,320,907.14
减：卖出股票成本总额	1,788,469,679.49	2,225,386,917.96
减：交易费用	1,412,856.31	1,577,835.42
买卖股票差价收入	107,259,165.60	7,356,153.76

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	329,467.95	428,020.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-114,257.71	101,540.38
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	215,210.24	529,561.11

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	49,784,048.31	23,521,780.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,094,077.00	23,040,650.00
减：应计利息总额	804,229.02	379,584.58
减：交易费用	-	5.80
买卖债券差价收入	-114,257.71	101,540.38

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
期货投资	1,325,517.78	159,359.79

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,670,241.68	7,367,152.58
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	5,670,241.68	7,367,152.58

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	16,391,826.75	10,434,933.50
——股票投资	16,319,569.75	10,538,160.50
——债券投资	72,257.00	-103,227.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-200,420.00	-126,520.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-200,420.00	-126,520.00
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	16,191,406.75	10,308,413.50

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	206,305.78	77,759.13

转换费收入	39,912.00	5,785.13
合计	246,217.78	83,544.26

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	34,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	12,578.53	8,155.33
账户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	14,242.39	62,721.22
合计	198,820.92	243,876.55

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	-	-	3,347,461,607.35	75.46%

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	48,157,851.33	99.88%

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	-	-	482,000,000.00	68.86%

## 7.4.10.1.4 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。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	136,920.90	77.74%	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,315,550.81	3,136,061.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,061,484.60	1,032,678.32
应支付基金管理人的净管理费	2,254,066.21	2,103,383.59

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	414,443.90	392,007.74

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 500 增强 A	创金合信中证 500 增强 C	合计
创金合信直销	-	43,474.66	43,474.66

第一创业证券	-	961.32	961.32
招商银行	-	32,265.97	32,265.97
合计	-	76,701.95	76,701.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 500 增强 A	创金合信中证 500 增强 C	合计
创金合信直销	-	36,118.43	36,118.43
第一创业证券	-	849.96	849.96
招商银行	-	13,972.40	13,972.40
合计	-	50,940.79	50,940.79

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 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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。

##### 7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	13,012,218.35	33,192.68	4,837,340.99	25,622.93

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

## 7.4.10.7 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。

## 7.4.10.8 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。

## 7.4.11 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。

## 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
600930	华电新能	2025 年 7 月 9 日	1-6 个月（含）	新股锁定	3.18	6.24	76,003	241,689.54	474,258.72	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	1-6 个月（含）	新股锁定	114.28	416.18	338	38,626.64	140,668.84	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	8.62	18.36	7,217	62,210.54	132,504.12	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	1-6 个月（含）	新股锁定	104.66	399.31	210	21,978.60	83,855.10	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	1-6 个月（含）	新股锁定	12.48	25.46	3,115	38,875.20	79,307.90	-

001280	中国铷业	2025 年 11 月 25 日	1-6 个月(含)	新股锁定	17.89	45.36	1,632	29,196.48	74,027.52	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	1-6 个月(含)	新股锁定	17.78	25.11	2,402	42,707.56	60,314.22	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	1-6 个月(含)	新股锁定	8.45	24.28	1,753	14,812.85	42,562.84	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	1-6 个月(含)	新股锁定	5.69	14.21	1,741	9,906.29	24,739.61	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	1-6 个月(含)	新股锁定	13.75	18.53	1,288	17,710.00	23,866.64	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	1-6 个月(含)	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	1-6 个月(含)	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	1-6 个月(含)	新股锁定	26.68	42.25	344	9,177.92	14,534.00	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	1-6 个月(含)	新股锁定	48.00	51.88	273	13,104.00	14,163.24	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	1-6 个月(含)	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	1-6 个月(含)	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	1-6 个月(含)	新股锁定	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月(含)	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	1-6 个月(含)	新股锁定	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	1-6 个月(含)	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-

		日								
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	6.85	12.89	624	4,274.40	8,043.36	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	46.36	59.06	125	5,795.00	7,382.50	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	42.28	56.08	126	5,327.28	7,066.08	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	46.68	55.66	111	5,181.48	6,178.26	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	1-6 个 月(含)	新股锁 定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年	1-6 个	新股锁	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-

		10月28日	月(含)	定						
603334	丰倍生物	2025年10月29日	1-6个月(含)	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	1-6个月(含)	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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 7,999,523.82 元，于 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 1 月 7 日(先后)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。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

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

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

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

##### 7.4.13.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	24,144,723.29	25,477,780.82
合计	24,144,723.29	25,477,780.82

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券以及无第三方评级机构短期债项评级的其他债券。

##### 7.4.13.2.2 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。

##### 7.4.13.2.3 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。

##### 7.4.13.2.4 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。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

#### 7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 8,001,916.71 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

##### 7.4.13.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主动投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 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	13,012,218.35	-	-	-	13,012,218.35
结算备付金	4,919,705.39	-	-	-	4,919,705.39
存出保证金	1,388,424.70	-	-	-	1,388,424.70
交易性金融资产	24,144,723.29	-	-	522,641,017.63	546,785,740.92
应收申购款	-	-	-	206,343.42	206,343.42
应收清算款	-	-	-	19,150,245.53	19,150,245.53
资产总计	43,465,071.73	-	-	541,997,606.58	585,462,678.31
负债					
卖出回购金融资产款	7,999,523.82	-	-	-	7,999,523.82
应付赎回款	-	-	-	18,546,937.21	18,546,937.21
应付管理人报酬	-	-	-	297,326.97	297,326.97
应付托管费	-	-	-	37,165.89	37,165.89
应付销售服务费	-	-	-	20,709.33	20,709.33
其他负债	-	-	-	202,553.05	202,553.05
负债总计	7,999,523.82	-	-	19,104,692.45	27,104,216.27
利率敏感度缺口	35,465,547.91	-	-	522,892,914.13	558,358,462.04
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,837,340.99	-	-	-	4,837,340.99
结算备付金	7,343,594.10	-	-	-	7,343,594.10
存出保证金	476,514.53	-	-	-	476,514.53
交易性金融资产	25,477,780.82	-	-	384,334,557.14	409,812,337.96
应收申购款	-	-	-	135,306.79	135,306.79
应收清算款	-	-	-	4,894,101.04	4,894,101.04
资产总计	38,135,230.44	-	-	389,363,964.97	427,499,195.41

负债					
卖出回购金 融资产款	13,002,328.7 9	-	-	-	13,002,328.7 9
应付赎回款	-	-	-	539,040.22	539,040.22
应付管理人 报酬	-	-	-	286,629.39	286,629.39
应付托管费	-	-	-	35,828.68	35,828.68
应付销售服 务费	-	-	-	17,993.00	17,993.00
应交税费	-	-	-	4,449.35	4,449.35
应付清算款	-	-	-	1,959,344.82	1,959,344.82
其他负债	-	-	-	208,004.65	208,004.65
负债总计	13,002,328.7 9	-	-	3,051,290.11	16,053,618.9 0
利率敏感度 缺口	25,132,901.6 5	-	-	386,312,674. 86	411,445,576.5 1

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

#### 7.4.13.4.1.2 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-33,607.16	-4,328.35
	2.市场利率平行下降25个基点	33,672.11	4,334.10

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	522,641,017.63	93.60	384,334,557.14	93.41
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	522,641,017.63	93.60	384,334,557.14	93.41

#### 7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	24,227,024.37	18,736,309.66
2.业绩比较基准下降 5%	-24,227,024.37	-18,736,309.66	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	521,279,488.06	384,331,037.14
第二层次	24,144,723.29	25,481,300.82
第三层次	1,361,529.57	-
合计	546,785,740.92	409,812,337.96

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	636,293.97	636,293.97
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	24,956.06	24,956.06
当期利得或损失总额	-	750,191.66	750,191.66
其中：计入损益的利得或损失	-	750,191.66	750,191.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,361,529.57	1,361,529.57
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或	-	730,125.20	730,125.20

损失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	843,014.69	843,014.69
当期购买	-	17,765.88	17,765.88
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	747,642.75	747,642.75
当期利得或损失总额	-	-113,137.82	-113,137.82
其中：计入损益的利得或损失	-	-113,137.82	-113,137.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,361,529.57	平均价格亚式期权模型	预期波动率	16.28%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2024 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2025 年 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	522,641,017.63	89.27
	其中：股票	522,641,017.63	89.27
2	固定收益投资	24,144,723.29	4.12
	其中：债券	24,144,723.29	4.12
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,931,923.74	3.06
7	其他各项资产	20,745,013.65	3.54
8	合计	585,462,678.31	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,037,645.00	2.87
C	制造业	350,814,862.59	62.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,812,911.00	0.50
E	建筑业	4,769,860.00	0.85
F	批发和零售业	15,006,563.00	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,397,620.00	0.25
H	住宿和餐饮业	5,582,143.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,860,969.86	6.60
J	金融业	12,379,787.00	2.22
K	房地产业	3,012,405.00	0.54
L	租赁和商务服务业	4,317,705.00	0.77

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,847,776.00	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,762,093.00	1.03
R	文化、体育和娱乐业	695,198.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	466,297,538.45	83.51

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	5,125,136.52	0.92
C	制造业	23,447,854.06	4.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,622,626.60	0.65
E	建筑业	110,856.00	0.02
F	批发和零售业	276,421.40	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	420,938.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	611,055.60	0.11
J	金融业	19,734,219.90	3.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,530,185.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	25,608.10	0.00
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	1,438,578.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	56,343,479.18	10.09

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002156	通富微电	230,013	8,671,490.10	1.55
2	688002	睿创微纳	84,370	8,504,496.00	1.52
3	600143	金发科技	428,400	8,370,936.00	1.50
4	000831	中国稀土	174,700	8,113,068.00	1.45
5	000021	深科技	315,000	7,963,200.00	1.43
6	688469	芯联集成	1,183,300	7,916,277.00	1.42
7	002273	水晶光电	309,180	7,766,601.60	1.39
8	002850	科达利	48,500	7,656,210.00	1.37
9	002414	高德红外	504,500	7,401,015.00	1.33
10	000034	神州数码	190,200	7,400,682.00	1.33
11	002152	广电运通	535,500	7,395,255.00	1.32
12	001696	宗申动力	329,800	7,153,362.00	1.28
13	000733	振华科技	134,200	7,033,422.00	1.26
14	000960	锡业股份	251,300	7,006,244.00	1.25
15	300748	金力永磁	204,700	6,982,317.00	1.25
16	601615	明阳智能	482,000	6,979,360.00	1.25
17	002841	视源股份	175,900	6,970,917.00	1.25
18	002203	海亮股份	546,508	6,918,791.28	1.24
19	002266	浙富控股	1,646,100	6,847,776.00	1.23
20	000951	中国重汽	401,900	6,792,110.00	1.22
21	300567	精测电子	74,000	6,748,800.00	1.21
22	600566	济川药业	255,300	6,714,390.00	1.20
23	688772	珠海冠宇	306,479	6,598,492.87	1.18
24	000887	中鼎股份	283,900	6,589,319.00	1.18
25	300017	网宿科技	625,600	6,412,400.00	1.15
26	600363	联创光电	99,400	6,268,164.00	1.12
27	300888	稳健医疗	159,800	6,046,832.00	1.08
28	002056	横店东磁	308,600	6,017,700.00	1.08
29	002444	巨星科技	176,100	5,990,922.00	1.07
30	002312	川发龙蟒	543,600	5,941,548.00	1.06
31	300679	电连技术	121,700	5,924,356.00	1.06
32	600763	通策医疗	143,300	5,762,093.00	1.03
33	002500	山西证券	960,100	5,750,999.00	1.03
34	002409	雅克科技	76,000	5,631,600.00	1.01
35	002410	广联达	446,500	5,616,970.00	1.01
36	600754	锦江酒店	220,900	5,582,143.00	1.00
37	600988	赤峰黄金	172,400	5,385,776.00	0.96
38	688777	中控技术	105,189	5,190,025.26	0.93
39	000709	河钢股份	2,208,500	5,101,635.00	0.91
40	000062	深圳华强	204,300	5,029,866.00	0.90

41	300073	当升科技	84,900	4,907,220.00	0.88
42	002831	裕同科技	165,100	4,707,001.00	0.84
43	000728	国元证券	549,800	4,590,830.00	0.82
44	002624	完美世界	277,200	4,543,308.00	0.81
45	300919	中伟股份	97,500	4,517,175.00	0.81
46	600498	烽火通信	140,600	4,510,448.00	0.81
47	002281	光迅科技	64,300	4,497,785.00	0.81
48	688266	泽璟制药	47,213	4,376,645.10	0.78
49	000528	柳工	367,700	4,364,599.00	0.78
50	000415	渤海租赁	1,066,100	4,317,705.00	0.77
51	000739	普洛药业	255,000	4,148,850.00	0.74
52	300724	捷佳伟创	40,800	3,900,480.00	0.70
53	301358	湖南裕能	60,200	3,892,532.00	0.70
54	600166	福田汽车	1,316,800	3,845,056.00	0.69
55	300383	光环新网	292,300	3,656,673.00	0.65
56	603290	斯达半导	37,000	3,555,330.00	0.64
57	300857	协创数据	20,400	3,441,072.00	0.62
58	601216	君正集团	709,700	3,420,754.00	0.61
59	300677	英科医疗	87,560	3,406,084.00	0.61
60	603345	安井食品	42,700	3,385,256.00	0.61
61	300002	神州泰岳	292,400	3,368,448.00	0.60
62	688301	奕瑞科技	32,500	3,286,075.00	0.59
63	000400	许继电气	126,600	3,254,886.00	0.58
64	300496	中科创达	45,700	3,084,750.00	0.55
65	300037	新宙邦	58,052	3,041,924.80	0.54
66	300136	信维通信	48,600	3,013,200.00	0.54
67	600380	健康元	253,040	2,922,612.00	0.52
68	600126	杭钢股份	356,800	2,911,488.00	0.52
69	300735	光弘科技	117,100	2,911,106.00	0.52
70	002683	广东宏大	59,100	2,824,980.00	0.51
71	688235	百济神州	10,270	2,758,522.00	0.49
72	000032	深桑达 A	141,600	2,739,960.00	0.49
73	002385	大北农	683,300	2,733,200.00	0.49
74	600435	北方导航	175,200	2,701,584.00	0.48
75	600487	亨通光电	103,700	2,564,501.00	0.46
76	002517	恺英网络	111,400	2,436,318.00	0.44
77	002244	滨江集团	230,200	2,313,510.00	0.41
78	002299	圣农发展	131,700	2,178,318.00	0.39
79	300373	扬杰科技	31,900	2,169,200.00	0.39
80	000921	海信家电	85,000	2,108,850.00	0.38
81	002008	大族激光	50,900	2,096,571.00	0.38
82	600170	上海建工	766,000	2,029,900.00	0.36
83	300207	欣旺达	76,600	2,003,090.00	0.36

84	002202	金风科技	97,800	1,995,120.00	0.36
85	688608	恒玄科技	8,660	1,965,300.40	0.35
86	300601	康泰生物	133,000	1,964,410.00	0.35
87	603129	春风动力	6,700	1,867,156.00	0.33
88	601168	西部矿业	67,500	1,865,700.00	0.33
89	002423	中粮资本	157,900	1,847,430.00	0.33
90	002821	凯莱英	19,500	1,812,135.00	0.32
91	600884	杉杉股份	132,400	1,788,724.00	0.32
92	603160	汇顶科技	21,800	1,722,200.00	0.31
93	600546	山煤国际	165,800	1,672,922.00	0.30
94	600562	国睿科技	59,100	1,670,166.00	0.30
95	000997	新大陆	56,300	1,594,416.00	0.29
96	605589	圣泉集团	56,124	1,588,309.20	0.28
97	300763	锦浪科技	22,100	1,578,161.00	0.28
98	002085	万丰奥威	96,764	1,549,191.64	0.28
99	688120	华海清科	9,700	1,455,776.00	0.26
100	002155	湖南黄金	68,200	1,438,338.00	0.26
101	688322	奥比中光	15,900	1,425,753.00	0.26
102	603707	健友股份	157,442	1,421,701.26	0.25
103	000582	北部湾港	149,000	1,397,620.00	0.25
104	000426	兴业银锡	39,200	1,395,520.00	0.25
105	600985	淮北矿业	124,400	1,382,084.00	0.25
106	001286	陕西能源	146,900	1,367,639.00	0.24
107	603179	新泉股份	18,200	1,344,616.00	0.24
108	300558	贝达药业	27,400	1,279,306.00	0.23
109	300450	先导智能	23,200	1,159,536.00	0.21
110	600521	华海药业	64,900	1,101,353.00	0.20
111	300972	万辰集团	4,300	864,601.00	0.15
112	000050	深天马 A	84,600	763,938.00	0.14
113	000539	粤电力 A	161,000	711,620.00	0.13
114	601155	新城控股	50,100	698,895.00	0.13
115	601921	浙版传媒	88,900	695,198.00	0.12
116	600998	九州通	134,100	686,592.00	0.12
117	688180	君实生物	17,900	611,464.00	0.11
118	600171	上海贝岭	19,400	606,250.00	0.11
119	600967	内蒙一机	30,100	505,680.00	0.09
120	000060	中金岭南	79,800	466,830.00	0.08
121	603927	中科软	23,940	457,014.60	0.08
122	601061	中信金属	31,600	455,040.00	0.08
123	600704	物产中大	80,100	446,157.00	0.08
124	601966	玲珑轮胎	28,900	419,917.00	0.08
125	688213	思特威	4,400	418,396.00	0.07
126	000729	燕京啤酒	36,600	411,018.00	0.07

127	600642	申能股份	49,300	383,554.00	0.07
128	600885	宏发股份	10,880	330,752.00	0.06
129	002568	百润股份	13,700	298,797.00	0.05
130	600021	上海电力	13,600	272,272.00	0.05
131	600563	法拉电子	2,000	209,900.00	0.04
132	601162	天风证券	45,800	190,528.00	0.03
133	688220	翱捷科技	2,300	190,003.00	0.03
134	600132	重庆啤酒	3,100	161,944.00	0.03
135	000683	博源化工	19,300	143,592.00	0.03
136	600511	国药股份	4,300	123,625.00	0.02
137	603589	口子窖	3,300	99,165.00	0.02
138	002558	巨人网络	1,900	82,251.00	0.01
139	600098	广州发展	11,900	77,826.00	0.01
140	601001	晋控煤业	5,500	72,325.00	0.01
141	603156	养元饮品	1,900	54,625.00	0.01
142	600038	中直股份	1,400	50,582.00	0.01
143	002436	兴森科技	2,000	42,340.00	0.01
144	300146	汤臣倍健	1,900	22,819.00	0.00
145	600737	中粮糖业	1,100	18,931.00	0.00
146	001221	悍高集团	194	11,079.34	0.00
147	688114	华大智造	100	6,076.00	0.00

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601328	交通银行	730,800	5,298,300.00	0.95
2	601899	紫金矿业	131,000	4,515,570.00	0.81
3	601318	中国平安	64,000	4,377,600.00	0.78
4	603296	华勤技术	46,346	4,205,436.04	0.75
5	600839	四川长虹	405,700	3,691,870.00	0.66
6	601336	新华保险	46,100	3,213,170.00	0.58
7	000988	华工科技	39,300	3,117,669.00	0.56
8	000543	皖能电力	307,900	2,447,805.00	0.44
9	601398	工商银行	279,100	2,213,263.00	0.40
10	002507	涪陵榨菜	147,270	1,901,255.70	0.34
11	601211	国泰海通	88,538	1,819,455.90	0.33
12	603236	移远通信	17,400	1,660,134.00	0.30
13	601999	出版传媒	209,400	1,438,578.00	0.26
14	600206	有研新材	47,600	967,708.00	0.17
15	600872	中炬高新	53,400	937,170.00	0.17
16	601138	工业富联	13,300	825,265.00	0.15

17	600415	小商品城	49,900	795,905.00	0.14
18	600919	江苏银行	72,700	756,080.00	0.14
19	603185	弘元绿能	24,500	747,250.00	0.13
20	300805	电声股份	69,600	734,280.00	0.13
21	600059	古越龙山	70,300	650,978.00	0.12
22	000601	韶能股份	137,700	647,190.00	0.12
23	601009	南京银行	55,300	632,079.00	0.11
24	688439	振华风光	9,300	600,780.00	0.11
25	601288	农业银行	74,700	573,696.00	0.10
26	300810	中科海讯	14,700	562,716.00	0.10
27	601628	中国人寿	10,800	491,400.00	0.09
28	600971	恒源煤电	76,400	476,736.00	0.09
29	600930	华电新能	76,075	474,711.60	0.09
30	605258	协和电子	14,900	465,923.00	0.08
31	603755	日辰股份	12,000	440,040.00	0.08
32	600787	中储股份	74,900	420,938.00	0.08
33	300317	珈伟新能	98,400	377,856.00	0.07
34	000581	威孚高科	17,800	367,036.00	0.07
35	601077	渝农商行	55,600	359,176.00	0.06
36	603501	豪威集团	2,400	302,160.00	0.05
37	600738	丽尚国潮	45,800	236,328.00	0.04
38	002463	沪电股份	3,100	226,517.00	0.04
39	603191	望变电气	12,900	191,049.00	0.03
40	688795	摩尔线程	338	140,668.84	0.03
41	301528	多浦乐	1,978	134,504.00	0.02
42	688783	西安奕材	7,237	132,980.12	0.02
43	000596	古井贡酒	1,000	132,600.00	0.02
44	688084	晶品特装	1,500	124,200.00	0.02
45	603815	交建股份	14,900	110,856.00	0.02
46	600543	莫高股份	16,900	89,739.00	0.02
47	600276	恒瑞医药	1,500	89,355.00	0.02
48	688802	沐曦股份	210	83,855.10	0.02
49	301656	联合动力	3,183	81,105.82	0.01
50	001280	中国铀业	1,657	75,550.52	0.01
51	603656	泰禾智能	3,000	69,090.00	0.01
52	688759	必贝特	2,403	60,343.28	0.01
53	601101	昊华能源	8,000	57,280.00	0.01
54	301232	飞沃科技	340	57,245.80	0.01
55	688530	欧莱新材	3,437	56,504.28	0.01
56	000767	晋控电力	18,900	52,920.00	0.01
57	688729	屹唐股份	1,825	44,325.40	0.01
58	600740	山西焦化	11,700	43,992.00	0.01
59	603376	大明电子	1,106	39,634.76	0.01

60	688548	广钢气体	2,065	30,025.10	0.01
61	301563	云汉芯城	194	27,578.90	0.00
62	301678	新恒汇	417	26,779.74	0.00
63	301638	南网数字	1,810	26,037.50	0.00
64	001386	马可波罗	1,291	23,934.83	0.00
65	688727	恒坤新材	630	22,832.40	0.00
66	300106	西部牧业	2,000	21,500.00	0.00
67	300908	仲景食品	700	19,390.00	0.00
68	301491	汉桑科技	343	18,997.79	0.00
69	001233	海安集团	307	16,191.68	0.00
70	688800	瑞可达	182	15,106.00	0.00
71	301609	山大电力	362	14,876.63	0.00
72	688796	百奥赛图	344	14,534.00	0.00
73	301315	威士顿	253	14,466.54	0.00
74	603079	圣达生物	800	14,176.00	0.00
75	001285	瑞立科密	246	14,063.28	0.00
76	301687	新广益	242	13,958.09	0.00
77	301667	纳百川	201	12,630.07	0.00
78	301584	建发致新	465	12,514.50	0.00
79	301668	昊创瑞通	245	11,232.80	0.00
80	600616	金枫酒业	2,000	10,720.00	0.00
81	603175	超颖电子	183	9,161.44	0.00
82	603406	天富龙	226	9,115.58	0.00
83	603418	友升股份	145	8,592.50	0.00
84	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
85	001369	双欣环保	637	8,257.99	0.00
86	601678	滨化股份	1,900	8,056.00	0.00
87	688651	盛邦安全	178	7,835.56	0.00
88	301449	天溯计量	118	7,812.34	0.00
89	301575	艾芬达	152	7,575.02	0.00
90	603262	技源集团	243	6,862.62	0.00
91	688700	东威科技	192	6,773.76	0.00
92	603334	丰倍生物	179	6,691.96	0.00
93	603092	德力佳	111	6,178.26	0.00
94	001388	信通电子	137	5,882.78	0.00
95	603370	华新精科	111	5,172.11	0.00
96	603248	锡华科技	292	4,941.04	0.00
97	001396	誉帆科技	88	3,261.76	0.00
98	688139	海尔生物	100	3,178.00	0.00
99	688549	中巨芯	20	182.40	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	600988	赤峰黄金	18,466,034.00	4.49
2	600839	四川长虹	16,858,137.09	4.10
3	600566	济川药业	16,676,756.90	4.05
4	000733	振华科技	15,571,089.00	3.78
5	601615	明阳智能	15,516,975.00	3.77
6	002156	通富微电	15,321,169.16	3.72
7	000021	深科技	13,672,892.00	3.32
8	002056	横店东磁	13,647,132.00	3.32
9	300567	精测电子	13,626,991.00	3.31
10	300136	信维通信	13,352,699.00	3.25
11	688772	珠海冠宇	13,192,456.36	3.21
12	300677	英科医疗	13,041,973.40	3.17
13	002850	科达利	12,406,953.00	3.02
14	002624	完美世界	12,258,512.00	2.98
15	002152	广电运通	12,131,008.00	2.95
16	600166	福田汽车	11,810,736.00	2.87
17	001696	宗申动力	11,759,493.00	2.86
18	002410	广联达	11,623,409.60	2.83
19	300476	胜宏科技	11,397,145.00	2.77
20	600763	通策医疗	11,391,021.56	2.77
21	688469	芯联集成	11,353,566.90	2.76
22	002841	视源股份	11,337,660.00	2.76
23	688777	中控技术	10,982,127.07	2.67
24	600487	亨通光电	10,941,268.00	2.66
25	300017	网宿科技	10,915,800.00	2.65
26	002203	海亮股份	10,760,196.40	2.62
27	688002	睿创微纳	10,716,278.00	2.60
28	600143	金发科技	10,623,892.00	2.58
29	300002	神州泰岳	10,458,169.00	2.54
30	002273	水晶光电	10,246,914.00	2.49
31	688608	恒玄科技	10,178,472.55	2.47
32	002312	川发龙蟒	10,139,206.00	2.46
33	688235	百济神州	10,059,344.34	2.44
34	689009	九号公司	10,059,144.78	2.44
35	600079	ST 人福	9,936,169.00	2.41
36	300073	当升科技	9,857,693.00	2.40
37	002444	巨星科技	9,849,055.00	2.39
38	002414	高德红外	9,678,158.20	2.35

39	601168	西部矿业	9,386,502.00	2.28
40	000988	华工科技	9,319,152.00	2.26
41	000951	中国重汽	9,258,663.00	2.25
42	300679	电连技术	9,126,017.00	2.22
43	002500	山西证券	9,087,718.00	2.21
44	000034	神州数码	8,974,765.00	2.18
45	000960	锡业股份	8,913,800.00	2.17
46	600754	锦江酒店	8,790,094.00	2.14
47	000062	深圳华强	8,786,825.00	2.14
48	002085	万丰奥威	8,740,788.56	2.12
49	300142	沃森生物	8,677,176.00	2.11
50	300888	稳健医疗	8,558,719.80	2.08
51	002625	光启技术	8,535,690.00	2.07
52	300037	新宙邦	8,516,298.04	2.07
53	000831	中国稀土	8,376,133.00	2.04
54	688676	金盘科技	8,371,728.06	2.03
55	000415	渤海租赁	8,337,250.00	2.03
56	000709	河钢股份	8,333,235.00	2.03
57	600418	江淮汽车	8,274,453.00	2.01
58	603129	春风动力	8,246,455.00	2.00

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。

#### 8.4.2 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	600988	赤峰黄金	17,209,386.66	4.18
2	600839	四川长虹	16,366,783.51	3.98
3	002532	天山铝业	15,244,027.00	3.70
4	600418	江淮汽车	13,842,841.00	3.36
5	300136	信维通信	13,062,661.15	3.17
6	300476	胜宏科技	12,770,618.00	3.10
7	688772	珠海冠宇	11,815,878.50	2.87
8	000039	中集集团	11,737,311.10	2.85
9	600487	亨通光电	11,262,521.43	2.74
10	688099	晶晨股份	11,102,504.60	2.70
11	600862	中航高科	10,956,328.90	2.66
12	000988	华工科技	10,892,289.14	2.65
13	000733	振华科技	10,619,323.00	2.58
14	002138	顺络电子	10,595,102.00	2.58
15	689009	九号公司	10,352,276.38	2.52
16	688578	艾力斯	10,138,526.95	2.46
17	688676	金盘科技	10,029,711.00	2.44

18	601615	明阳智能	10,004,482.00	2.43
19	688235	百济神州	9,939,527.89	2.42
20	002340	格林美	9,860,220.00	2.40
21	600566	济川药业	9,839,427.00	2.39
22	600380	健康元	9,801,685.00	2.38
23	600079	ST 人福	9,751,023.00	2.37
24	002156	通富微电	9,697,265.00	2.36
25	600498	烽火通信	9,594,786.00	2.33
26	000636	风华高科	9,541,094.92	2.32
27	300677	英科医疗	9,485,915.60	2.31
28	300002	神州泰岳	9,360,928.00	2.28
29	300567	精测电子	9,318,592.00	2.26
30	000032	深桑达 A	9,314,607.00	2.26
31	601168	西部矿业	9,190,142.00	2.23
32	600765	中航重机	9,091,623.00	2.21
33	600580	卧龙电驱	9,082,750.00	2.21
34	002202	金风科技	8,999,621.96	2.19
35	603228	景旺电子	8,908,937.00	2.17
36	000021	深科技	8,820,199.00	2.14
37	002056	横店东磁	8,692,638.00	2.11
38	002624	完美世界	8,680,401.00	2.11
39	300054	鼎龙股份	8,607,281.00	2.09
40	002384	东山精密	8,497,796.00	2.07
41	300395	菲利华	8,301,944.00	2.02
42	600166	福田汽车	8,296,986.00	2.02
43	300212	易华录	8,289,357.07	2.01
44	688608	恒玄科技	8,285,255.87	2.01
45	002273	水晶光电	8,270,804.00	2.01

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,908,906,418.85
卖出股票收入（成交）总额	1,897,141,701.40

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。

#### 8.5 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	24,144,723.29	4.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,144,723.29	4.32

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	240,000	24,144,723.29	4.32

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 8.12.3 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	1,388,424.70
2	应收清算款	19,150,245.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	206,343.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,745,013.65

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
创金合信中证 500 增强 A	19,247	6,845.00	34,166,423.27	25.93%	97,579,317.06	74.07%
创金合信中证 500 增强 C	28,590	8,425.06	147,458,704.97	61.22%	93,413,703.82	38.78%
合计	47,375	7,865.29	181,625,128.24	48.74%	190,993,020.88	51.26%

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）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证 500 增强 A	583,568.78	0.44%
	创金合信中证 500 增强 C	44,099.27	0.02%
	合计	627,668.05	0.17%

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）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证 500 增强 A	0~10
	创金合信中证 500 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证 500 增强 A	0
	创金合信中证 500 增强 C	0
	合计	0

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限

		比例 (%)		比例 (%)	
基金管理人 固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人 高级管理人员	489.56	0.00	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	489.56	0.00	0.00	0.00	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信中证 500 增强 A	创金合信中证 500 增强 C
基金合同生效日(2015 年 12 月 31 日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	182,767,648.33	185,899,303.58
本报告期基金总申购份额	78,379,093.44	286,575,191.33
减：本报告期基金总赎回份额	129,401,001.44	231,602,086.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	131,745,740.33	240,872,408.79

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 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，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所,本年度支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 34,000.00 元,该审计机构连续提供审计服务的年限为 6 年。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	创金合信基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 31 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正并暂停新增私募资管产品备案 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、其他问题(销售管理等方面存在部分内部控制制度不完善或执行不到位的情况)
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》第六十八条第一款;《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第五十三条等相关规定
管理人采取整改措施的情况	截至报告期末,已按照监管要求通过完善制度、优化流程等措施完成整改
其他	-

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	部分高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、其他问题(销售管理等方面存在部分内部控制制度不完善或执行不到位的情况)
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》第六十八条第一款;《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第五十三条等相关规定
管理人采取整改措施的情况	截至报告期末,已按照监管要求通过完善制

	度、优化流程等措施完成整改
其他	-

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用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	
民生证券	2	2,251,140,610.22	59.23%	165,395.80	74.81%	-
中信证券	2	1,549,841,555.50	40.77%	55,684.73	25.19%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	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、本基金报告期内新租东北证券 2 个交易单元，退租德邦证券 2 个交易单元、国泰海通证券 2 个交易单元。

### 11.7.2 基金租用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
民生证券	47,981,235.00	49.47%	312,000,000.00	48.19%	-	-
中信证券	49,005,204.29	50.53%	335,400,000.00	51.81%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
2	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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	2025-03-19
3	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
4	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2025 年 3 月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
5	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2025 年 3 月修订）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
6	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（2025 年 3 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	2025-03-19
7	关于创金合信基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
8	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-28
9	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-21
10	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
11	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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	2025-06-26
12	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
13	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（2025 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	2025-06-26
14	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-18
15	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-07
16	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-28
17	创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250916 - 20251019	0.00	71,829,303.50	70,832,521.47	996,782.03	0.27%
机构	2	20251218 - 20251231	0.00	138,166,874.70	0.00	138,166,874.70	37.08%

## 产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年度报告原文。

## 13.2 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

## 13.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司

2026 年 3 月 30 日