

创金合信弘达债券型证券投资基金 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：苏州银行股份有限公司

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。

基金托管人苏州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 3 月 27 日（基金合同生效日）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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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.....	16
§7 投资组合报告.....	43
7.1 报告期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48
7.13 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 盈利投资者数量占比	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信弘达债券型证券投资基金	
基金简称	创金合信弘达债券	
基金主代码	026676	
交易代码	026676	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 3 月 27 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	122,000,705.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信弘达债券 A	创金合信弘达债券 C
下属分级基金的交易代码	026676	026677
报告期末下属分级基金的份额总额	122,000,695.62 份	10.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 （1）利率预期策略、（2）期限结构配置策略、（3）债券类别配置策略、（4）信用类债券投资策略、（5）回购放大策略、（6）可转换债券和可交换债券投资策略 3、股票投资策略 4、国债期货投资策略 5、信用衍生品投资策略 6、基金投资策略
业绩比较基准	中债-新综合财富(总值)指数收益率*89%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*1%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限	苏州银行股份有限公司

		公司	
信息披露负责人	姓名	奚胜田	董平
	联系电话	0755-82820166	0512-69868888-91017
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	custodyacc@suzhoubank.com
客户服务电话		400-868-0666	96067
传真		0755-25832571	0512-65135118
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道时代大街 200 号创金大厦 3101	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号
邮政编码		518052	215100
法定代表人		青美平措	崔庆军

注：1. 创金合信基金管理有限公司已变更董事长，法定代表人同步变更，详见公司官网 2026 年 7 月 25 日披露的公告——《创金合信基金管理有限公司董事长变更公告》；

2. 创金合信基金管理有限公司已变更注册地址，详见公司官网 2026 年 7 月 30 日披露的公告——《创金合信基金管理有限公司关于住所变更的公告》。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信弘达债券 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 3 月 27 日 - 2026 年 6 月 30 日)
---------------	--

本期已实现收益	1,124,237.79
本期利润	376,171.62
加权平均基金份额本期利润	0.0035
本期加权平均净值利润率	0.35%
本期基金份额净值增长率	-0.05%
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	-59,389.06
期末可供分配基金份额利润	-0.0005
期末基金资产净值	121,941,306.56
期末基金份额净值	0.9995
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	-0.05%

2、创金合信弘达债券 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 3 月 27 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	0.10
本期利润	-
加权平均基金份额本期利润	-
本期加权平均净值利润率	-
本期基金份额净值增长率	-0.20%
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	-0.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0020
期末基金资产净值	9.98
期末基金份额净值	0.9980
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	-0.20%

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

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 本基金合同生效日为 2026 年 3 月 27 日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

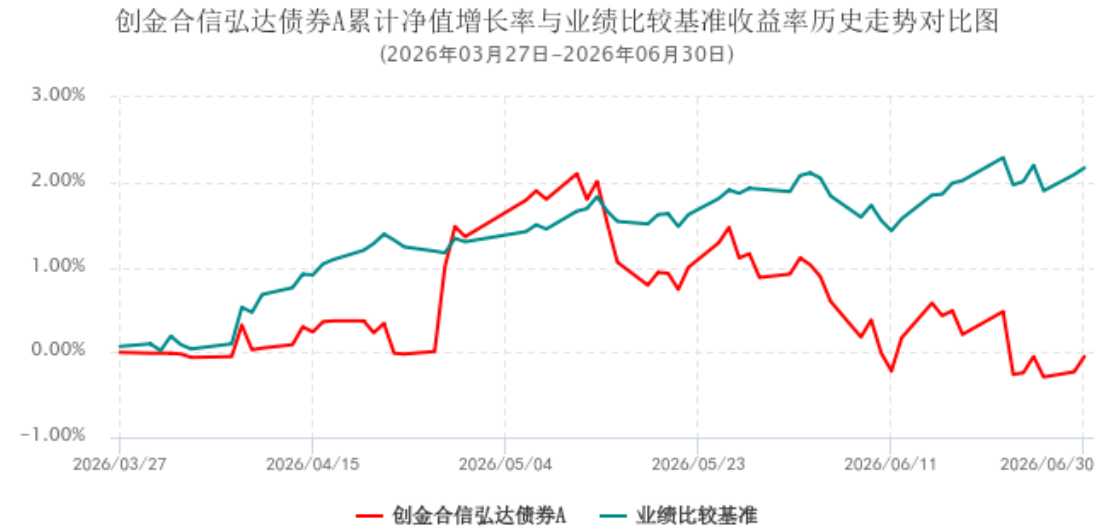
创金合信弘达债券 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.04%	0.28%	2.15%	0.14%	-2.19%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-0.05%	0.28%	2.17%	0.14%	-2.22%	0.14%

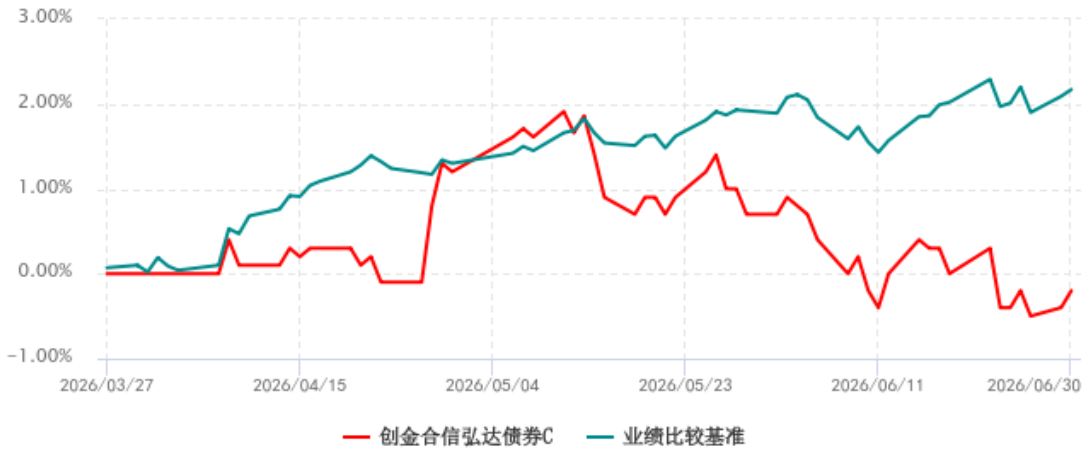
创金合信弘达债券 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.20%	0.28%	2.15%	0.14%	-2.35%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-0.20%	0.27%	2.17%	0.14%	-2.37%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



创金合信弘达债券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
(2026年03月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2026 年 3 月 27 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 2 日获得中国证监会核准设立的批复，2014 年 7 月 9 日成立，注册地为深圳市。目前创金合信基金注册资本为 26,096 万元人民币，第一创业证券股份有限公司出资比例为 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）出资比例为 4.63596%。

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘润哲	本基金	2026 年 4	-	14	刘润哲先生，中国国籍，康涅狄格大学

	基金经 理、稳 健收益 投资部 负责 人、多 资产投 资管理 部执行 总监	月 7 日			硕士。2011 年 9 月加入美林银行 (Merrill Lynch)，任投资顾问，2012 年 9 月加入中国人寿保险股份有限公司，任精算部主管，2016 年 1 月加入中国民生银行股份有限公司，任资产管理部投资经理，2022 年 5 月加入创金合信基金管理有限公司，现任稳健收益投资部负责人、兼任多资产投资管理部执行总监、基金经理。
谢创	本基金 基金经 理、固 收投资 部负责 人	2026 年 4 月 4 日	-	10	谢创先生，中国国籍，西南财经大学硕士。2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任交易部交易员、固定收益部基金经理助理，固定收益部总监助理，现任固收投资部负责人、基金经理。
黄佳祥	本基金 基金经 理	2026 年 3 月 27 日	-	8	黄佳祥先生，中国国籍，厦门大学博士。2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，现任基金经理。
谢鑫	本基金 基金经 理、固 收策略 与指数 投资部 负责人	2026 年 3 月 27 日	-	14	谢鑫先生，中国国籍，中国科学院研究生院硕士，2011 年 7 月加入中国国际期货股份有限公司，任研究院研究员，2012 年 9 月加入北京光合大有投资管理有限公司，任投资部投资经理，2015 年 4 月加入光大期货有限公司，任互联网金融部投资经理，2017 年 6 月加入中国邮政储蓄银行股份有限公司，任资产管理部资产组合处投资经理，2020 年 4 月加入中邮理财有限责任公司，历任组合策略部投资经理、组合策略部副总经理，2024 年 4 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固收混合资产投资部负责人、固收策略与指数投资部负责人、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；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2026 年 7 月 18 日起谢鑫先生离任本基金的基金经理。

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

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

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

间置信度逐步提升的板块；此外随着美联储政策逐步回归相机抉择、地缘风险边际缓和，低估值板块有望迎来修复，产品维持在科技、传统制造业、化工、有色、航空、农业、环保等价值板块进行均衡配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信弘达债券 A 基金份额净值为 0.9995 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%；截至本报告期末创金合信弘达债券 C 基金份额净值为 0.9980 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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、利润分配、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 年度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：创金合信弘达债券型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	1,170,378.11
结算备付金		-
存出保证金		8,455,813.49
交易性金融资产	6.4.7.2	107,435,254.53
其中：股票投资		9,963,133.56
基金投资		2,628,547.30
债券投资		94,843,573.67

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	8,000,368.22
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		125,061,814.35
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		3,038,177.88
应付赎回款		-
应付管理人报酬		24,118.64
应付托管费		4,823.73
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		962.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	52,415.52
负债合计		3,120,497.81
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	122,000,705.62
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-59,389.08
净资产合计		121,941,316.54
负债和净资产总计		125,061,814.35

注：1. 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，创金合信弘达债券 A 份额净值 0.9995 元，基金份额总额 122,000,695.62 份；创金合信弘达债券 C 份额净值 0.9980 元，基金份额总额 10.00 份；总份额合计 122,000,705.62 份；

2. 本财务报表的实际报告期间为 2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：创金合信弘达债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		592,372.60
1.利息收入		40,119.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,199.40
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		20,920.43
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,300,319.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	797,255.58
基金投资收益	6.4.7.15	181,418.65
债券投资收益	6.4.7.16	281,267.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	40,377.51
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）	6.4.7.21	-748,066.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-
减：二、营业总支出		216,200.98
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	139,730.02
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	27,945.99
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	6.4.7.24	-
7.税金及附加		968.45
8.其他费用	6.4.7.25	47,556.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		376,171.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		376,171.62
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		376,171.62

注：本财务报表的实际报告期间为 2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信弘达债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,022,563.88	-	-	203,022,563.88

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,021,858.26	-	-59,389.08	-81,081,247.34
（一）、综合收益总额	-	-	376,171.62	376,171.62
（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）	-81,021,858.26	-	-435,560.70	-81,457,418.96
其中：1.基金申购款	71,980,199.59	-	-62,265.59	71,917,934.00
2.基金赎回款	-153,002,057.85	-	-373,295.11	-153,375,352.96
（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	122,000,705.62	-	-59,389.08	121,941,316.54

注：本财务报表的实际报告期间为 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效不满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

创金合信弘达债券型证券投资基金（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”）2025 年 12 月 30 日证监许可[2025]3010 号文《关于准予创金合信弘达债券型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2026 年 3 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限

不定，首次设立募集规模为 203,022,563.88 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，基金托管人为苏州银行股份有限公司（以下简称“苏州银行”）。

本基金于 2026 年 3 月 16 日至 2026 年 3 月 25 日募集，募集期间净认购资金人民币 203,013,228.92 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 9,334.96 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 203,022,563.88 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了毕马威华振验字第 2600263 号验资报告。

根据《创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人通过直销机构以外的其他销售机构认购、申购时收取认购费、申购费，但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额，投资人通过直销机构认购、申购 A 类基金份额时不收取认购费、申购费。在投资人认购、申购时不收取认购费、申购费，而是从直销机构以外的其他销售机构持有的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（其中，对于投资人通过直销机构认购或申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资人赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资人，对于投资人通过其他销售机构认购或申购且持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，超过一年继续计提的销售服务费将在投资人赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资人）。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同，本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值，计算公式如下：T 日某类基金份额的基金份额净值 = T 日该类基金份额的基金资产净值 / T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信弘达债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型 ETF 及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和其他可投资公募基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外））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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金等权益类资产以及可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券的比例合计为基金资产

的 5%-20%，其中投资于境内股票资产的比例不低于基金资产的 5%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终在扣除国债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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60% 的混合型基金。本基金的业绩比较基准为：中债-新综合财富（总值）指数收益率*89%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*1%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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、基金投资、债券投资、买入返售金融资产等。

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

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

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

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(b) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(c) 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；

(d) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

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

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,170,378.11
等于：本金	1,170,091.53
加：应计利息	286.58
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	1,170,378.11

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		10,946,466.02	-	9,963,133.56	-983,332.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,026,273.97	75,046.58	10,081,046.58	-20,273.97
	银行间市场	83,764,950.66	940,827.09	84,762,527.09	56,749.34
	合计	93,791,224.63	1,015,873.67	94,843,573.67	36,475.37
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,429,756.48	-	2,628,547.30	198,790.82
其他		-	-	-	-
合计		107,167,447.13	1,015,873.67	107,435,254.53	-748,066.27

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	8,000,368.22	-

合计	8,000,368.22	-
----	--------------	---

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,259.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,259.00
应付利息	-
预提费用	47,156.52
合计	52,415.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信弘达债券 A		
项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	203,022,553.88	203,022,553.88

本期申购	71,980,189.71	71,980,189.71
本期赎回（以“-”号填列）	-153,002,047.97	-153,002,047.97
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	122,000,695.62	122,000,695.62

创金合信弘达债券 C		
项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10.00	10.00
本期申购	9.88	9.88
本期赎回（以“-”号填列）	-9.88	-9.88
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	10.00	10.00

注：1. 申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

2. 本基金自 2026 年 3 月 16 日至 2026 年 3 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 203,013,228.92 元，其中 A 类基金募集有效净认购资金为 203,013,218.92 元，其中 C 类基金募集有效净认购资金为 10.00 元。根据《创金合信弘达债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 9,334.96 元，在本基金成立后，折算为 9,334.96 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

创金合信弘达债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,124,237.79	-748,066.17	376,171.62
本期基金份额交易产生的变动数	-555,104.17	119,543.49	-435,560.68
其中：基金申购款	344,034.76	-406,300.47	-62,265.71
基金赎回款	-899,138.93	525,843.96	-373,294.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	569,133.62	-628,522.68	-59,389.06

创金合信弘达债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	0.10	-0.10	-
本期基金份额交易产生的变动数	-0.08	0.06	-0.02
其中：基金申购款	0.06	0.06	0.12
基金赎回款	-0.14	-	-0.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	0.02	-0.04	-0.02

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,789.17
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	-
其他	10,410.23
合计	19,199.40

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	797,255.58
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	797,255.58

6.4.7.14.2 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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	49,537,363.07
减：卖出股票成本总额	48,703,176.55
减：交易费用	36,930.94
买卖股票差价收入	797,255.58

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入**6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入****6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入****6.4.7.15 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） 至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	3,490,166.10
减：卖出/赎回基金成本总额	3,302,250.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	5,575.16
减：交易费用	921.87
基金投资收益	181,418.65

6.4.7.16 债券投资收益**6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） 至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	355,125.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-73,858.61
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	281,267.30

6.4.7.16.2 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 3 月 27 日（基金合同生效日）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	255,648,497.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	252,240,265.37
减：应计利息总额	3,468,017.77
减：交易费用	14,072.96
买卖债券差价收入	-73,858.61

6.4.7.17 资产支持证券投资收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入****6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入****6.4.7.18 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） 至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	40,377.51
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	40,377.51

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-748,066.27
——股票投资	-983,332.46
——债券投资	36,475.37
——资产支持证券投资	-
——基金投资	198,790.82
——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	-748,066.27

6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） 至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	0.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,502.12
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	331.75

注：1. 上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；

2. 上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,871.08
信息披露费	34,285.44
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	47,556.52

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

苏州银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	139,730.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,788.04
应支付基金管理人的净管理费	129,941.98

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 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,945.99

注：支付基金托管人苏州银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

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 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

苏州银行股份有 限公司	1,170,378.11	8,789.17
----------------	--------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人苏州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

本基金本报告期末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

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2026 年 3 月 27 日（基金合同生效日） 至 2026 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	-

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	74,467,725.83
AAA 以下	-
未评级	20,375,847.84
合计	94,843,573.67

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,170,378.11	-	-	-	1,170,378.11
存出保证金	8,455,813.49	-	-	-	8,455,813.49
交易性金融资产	9,114,218.63	82,624,106.00	3,105,249.04	12,591,680.86	107,435,254.53
买入返售金融资产	8,000,368.22	-	-	-	8,000,368.22
资产总计	26,740,778.45	82,624,106.00	3,105,249.04	12,591,680.86	125,061,814.35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,118.64	24,118.64
应付托管费	-	-	-	4,823.73	4,823.73
应交税费	-	-	-	962.04	962.04
应付清算款	-	-	-	3,038,177.88	3,038,177.88
其他负债	-	-	-	52,415.52	52,415.52
负债总计	-	-	-	3,120,497.81	3,120,497.81
利率敏感度缺口	26,740,778.45	82,624,106.00	3,105,249.04	9,471,183.05	121,941,316.54

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)
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-563,928.98
	2.市场利率平行下降 25 个基点	570,305.32

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	-	206,497.76	-	-	-	206,497.76
资产合计	-	206,497.76	-	-	-	206,497.76
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	-	206,497.76	-	-	-	206,497.76

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)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	10,324.89
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-10,324.89

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	9,963,133.56	8.17
交易性金融资产-基金投资	2,628,547.30	2.16
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	12,591,680.86	10.33

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）
	1.业绩比较基准上升 5%	847,042.37
	2.业绩比较基准下降 5%	-847,042.37

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	12,591,680.86
第二层次	94,843,573.67
第三层次	-
合计	107,435,254.53

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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告**7.1 报告期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,963,133.56	7.97
	其中：股票	9,963,133.56	7.97
2	基金投资	2,628,547.30	2.10
3	固定收益投资	94,843,573.67	75.84
	其中：债券	94,843,573.67	75.84
	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	8,000,368.22	6.40
	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	1,170,378.11	0.94
8	其他各项资产	8,455,813.49	6.76
9	合计	125,061,814.35	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 206,497.76 元，占净值比为 0.17%。

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	1,522,431.00	1.25
C	制造业	6,752,397.80	5.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,561.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	660,809.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	383,812.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	14,352.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	406,273.00	0.33
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	9,756,635.80	8.00

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（%）
信息技术	206,497.76	0.17
合计	206,497.76	0.17

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300037	新宙邦	11,300	1,049,205.00	0.86
2	600547	山东黄金	40,200	928,218.00	0.76
3	600160	巨化股份	15,700	832,257.00	0.68
4	600885	宏发股份	21,900	755,331.00	0.62
5	601111	中国国航	102,700	621,335.00	0.51
6	301392	汇成真空	1,800	519,552.00	0.43
7	600323	瀚蓝环境	14,400	395,424.00	0.32
8	300138	晨光生物	42,800	385,200.00	0.32
9	002027	分众传媒	79,300	383,812.00	0.31
10	002106	莱宝高科	21,000	367,920.00	0.30
11	300750	宁德时代	900	353,709.00	0.29
12	300483	首华燃气	18,300	321,714.00	0.26
13	301631	壹连科技	3,000	215,580.00	0.18
14	300394	天孚通信	700	211,876.00	0.17
15	601898	中煤能源	16,800	204,624.00	0.17
16	H00981	中芯国际	2,000	155,296.74	0.13
17	600346	恒力石化	8,700	154,077.00	0.13
18	300656	民德电子	3,900	148,551.00	0.12
19	000933	神火股份	6,900	146,280.00	0.12
20	300274	阳光电源	900	143,118.00	0.12
21	600482	中国动力	4,100	134,480.00	0.11
22	603005	晶方科技	2,400	129,288.00	0.11
23	600418	江淮汽车	4,900	126,567.00	0.10
24	601231	环旭电子	3,800	123,120.00	0.10
25	000333	美的集团	1,600	120,848.00	0.10
26	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.09
27	300910	瑞丰新材	3,970	111,318.80	0.09
28	300903	科翔股份	1,000	101,310.00	0.08
29	688301	奕瑞科技	637	78,988.00	0.06
30	600458	时代新材	4,600	76,130.00	0.06
31	600309	万华化学	1,100	75,251.00	0.06
32	000100	TCL 科技	12,600	73,332.00	0.06
33	600938	中国海油	2,500	67,875.00	0.06
34	600352	浙江龙盛	4,800	58,128.00	0.05
35	603639	海利尔	5,500	54,560.00	0.04
36	H00148	建滔集团	500	51,201.02	0.04
37	002595	豪迈科技	900	41,940.00	0.03

38	603861	白云电器	3,200	41,312.00	0.03
39	600115	中国东航	8,200	31,242.00	0.03
40	601965	中国汽研	1,200	14,352.00	0.01
41	600905	三峡能源	3,700	13,727.00	0.01
42	002627	三峡旅游	1,900	10,849.00	0.01
43	603885	吉祥航空	800	8,232.00	0.01
44	600285	羚锐制药	400	7,752.00	0.01
45	600674	川投能源	200	2,834.00	0.00
46	688012	中微公司	2	937.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600031	三一重工	2,633,517.00	2.16
2	603993	洛阳钼业	1,924,588.00	1.58
3	688099	晶晨股份	1,891,538.88	1.55
4	001233	海安集团	1,818,495.00	1.49
5	600547	山东黄金	1,609,865.00	1.32
6	601633	长城汽车	1,520,113.00	1.25
7	000630	铜陵有色	1,422,897.00	1.17
8	603786	科博达	1,401,386.00	1.15
9	600309	万华化学	1,361,610.00	1.12
10	000680	山推股份	1,319,523.00	1.08
11	001288	运机集团	1,315,869.00	1.08
12	000933	神火股份	1,307,949.00	1.07
13	688012	中微公司	1,221,317.38	1.00
14	601995	中金公司	1,218,859.74	1.00
15	300037	新宙邦	1,161,902.00	0.95
16	603861	白云电器	1,056,636.00	0.87
17	601111	中国国航	1,056,161.00	0.87
18	600073	光明肉业	990,268.00	0.81
19	600584	长电科技	946,327.11	0.78
20	000100	TCL 科技	854,874.00	0.70

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600031	三一重工	2,673,588.00	2.19

2	688099	晶晨股份	2,436,431.45	2.00
3	603993	洛阳钼业	2,079,813.00	1.71
4	001233	海安集团	1,857,188.00	1.52
5	000630	铜陵有色	1,490,902.00	1.22
6	603786	科博达	1,416,008.50	1.16
7	688012	中微公司	1,390,830.31	1.14
8	601633	长城汽车	1,347,579.02	1.11
9	001288	运机集团	1,290,347.00	1.06
10	000680	山推股份	1,270,369.00	1.04
11	600309	万华化学	1,233,918.00	1.01
12	601995	中金公司	1,223,602.00	1.00
13	000933	神火股份	1,085,285.00	0.89
14	600584	长电科技	1,009,858.00	0.83
15	603861	白云电器	976,336.00	0.80
16	600073	光明肉业	960,532.00	0.79
17	002156	通富微电	888,309.00	0.73
18	603279	景津装备	867,768.00	0.71
19	601688	华泰证券	852,026.00	0.70
20	000100	TCL 科技	820,203.00	0.67

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	59,649,642.57
卖出股票收入（成交）总额	49,537,363.07

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	央行票据	-	-
3	金融债券	88,737,088.30	72.77
	其中：政策性金融债	14,269,362.47	11.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	6,106,485.37	5.01
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	94,843,573.67	77.78

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	232380066	23 中行二级资本债 03A	100,000	10,649,696.99	8.73
2	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	100,000	10,547,640.55	8.65
3	232480004	24 农行二级资本债 01A	100,000	10,398,715.07	8.53
4	092280139	22 交行二级资本债 02A	100,000	10,391,416.99	8.52
5	138664	22 中金 G1	100,000	10,081,046.58	8.27

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本产品基金投资以长期风险收益特征，夏普比率卡玛比率具备优势的主动管理基金和 ETF 为主，投资标的对应各类风险敞口进行穿透式审慎式评估，并纳入产品进行综合风险管理。

7.12.2 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基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于 基金管理人及管理人关联方 所管理的基金
1	515880	国泰中证全指通信设备 ETF	交易型开放式	362,800.00	651,588.80	0.53	否
2	159994	5GETF	交易型开放式	350,200.00	598,141.60	0.49	否
3	159566	易方达国证新能源电池 ETF	交易型开放式	211,200.00	479,212.80	0.39	否
4	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式	40,600.00	203,771.40	0.17	否
5	159381	华夏创业板人工智能 ETF	交易型开放式	121,100.00	178,017.00	0.15	否
6	159995	华夏国证半导体芯片 ETF	交易型开放式	35,400.00	120,006.00	0.10	否
7	159748	富国中证沪港深创新药产业 ETF	交易型开放式	163,000.00	117,523.00	0.10	否
8	561100	富国中证消费电子主题 ETF	交易型开放式	47,200.00	105,869.60	0.09	否
9	512890	红利低波	交易型开放式	89,700.00	95,709.90	0.08	否
10	561330	国泰中证有色金属矿业主题	交易型开放式	83,200.00	78,707.20	0.06	否

		ETF					
--	--	-----	--	--	--	--	--

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚的情况；交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚的情况；上海浦东发展银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局上海市分局处罚的情况；中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情况；中国邮政集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到大兴安岭地区邮政管理局、岳阳市邮政管理局、天津市邮政管理局第一分局、天津市邮政管理局、青岛市市北区综合行政执法局处罚的情况；中信银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局云南监管局、国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚的情况。

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

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

7.13.2

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。

7.13.3 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	8,455,813.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,455,813.49

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信弘达债券 A	286	426,575.86	110,031,247.28	90.19%	11,969,448.34	9.81%
创金合信弘达债券 C	1	10.00	-	-	10.00	100.00%
合计	287	425,089.57	110,031,247.28	90.19%	11,969,458.34	9.81%

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

8.2 盈利投资者数量占比

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信弘达债券 A	1,529.02	0.00%
	创金合信弘达债券 C	0.00	0.00%
	合计	1,529.02	0.00%

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信弘达债券 A	创金合信弘达债券 C
基金合同生效日(2026 年 3 月 27 日)基金份额总额	203,022,553.88	10.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	71,980,189.71	9.88
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	153,002,047.97	9.88
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,000,695.62	10.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 2 日起，陈定坤先生担任基金管理人非职工监事，4 月 3 日起担任基金管理人监事会主席。2026 年 4 月 2 日起，宋明华先生不再担任基金管理人非职工监事、监事会主席。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营及基金运作产生重大影响的与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人高级管理人员和相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	4	109,187,005.64	100.00%	14,879.55	100.00%	-

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、本基金在报告期内成立, 交易单元均于本期内新增。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	446,784,362.73	100.00%	473,300,000.00	100.00%	-	-	9,222,173.00	100.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信弘达债券型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
2	创金合信弘达债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
3	创金合信弘达债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
4	创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
5	创金合信弘达债券型证券投资基金托管协议	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
6	创金合信弘达债券型证券投资基金招募说明书	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-12
7	创金合信弘达债券型证券投资基金提前结束募集的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-24
8	创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-28
9	创金合信基金管理有限公司关于旗下创金合信	公司官网、证券时报、	2026-03-30

	弘达债券型证券投资基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会基金电子披露网站	
10	创金合信弘达债券型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07
11	创金合信弘达债券型证券投资基金（2026 年 4 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
12	创金合信弘达债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
13	创金合信弘达债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
14	创金合信弘达债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
15	创金合信弘达债券型证券投资基金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
16	创金合信弘达债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
17	创金合信弘达债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 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

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	20260326 - 20260630	50,003,333.33	0.00	0.00	50,003,333.33	40.99%
机构	2	20260428 - 20260510	19,999,666.66	0.00	19,999,666.66	0.00	0.00%
机构	3	20260626 - 20260630	14,999,000.00	40,019,909.95	14,999,000.00	40,019,909.95	32.80%
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)若本基金在短期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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信弘达债券型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信弘达债券型证券投资基金 2026 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日