

# 创金合信均益量化选股混合型证券投资 基金 2025 年年度报告

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	6
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.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	67
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.....	67
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.....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	67
§9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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的情况.....	69
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	69
§11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
11.8 其他重大事件.....	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	74
13.1 备查文件目录.....	74
13.2 存放地点.....	74
13.3 查阅方式.....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信均益量化选股混合	
基金主代码	020224	
交易代码	020224	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	85,045,649.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	020224	020225
报告期末下属分级基金的份额总额	58,589,687.76 份	26,455,961.42 份

### 2.2 基金产品说明

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

	<p>际通用的多因子模型为基础框架筛选 A 股上市公司股票，根据国内资本市场的特点和大量历史数据的实证检验，结合基金管理人量化团队多年定量研究与投资的经验，充分挖掘持续稳健的超额收益因子，精选并持有预期收益较好的股票构成投资组合。本基金所采用的多因子模型主要包括基本面因子、分析师因子、价量因子、事件因子等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。</p> <p>①基本面因子 基本面因子指个股估值、盈利能力、盈利质量等方面的财务信息，代表公司的经营能力。主要包括以下指标：市盈率、市净率、营业收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、销售毛利率等。</p> <p>②分析师因子 分析师因子指证券分析师对个股财务数据的预测信息，代表其对公司未来前景的判断。主要包括以下指标：一致预期营业收入增长率、一致预期净利润增长率、一致预期净资产收益率等。</p> <p>③价量因子 价量因子指个股的市场行情信息，主要包括以下指标：历史收益率、历史换手率等。</p> <p>④事件因子 事件因子指个股的公告、新闻等信息，主要包括以下指标：大股东增减持事件、并购重组事件、机构调研事件等。</p> <p>(2) 港股通标的股票投资策略 本基金将通过定量与定性相结合的分析方法进行港股投资。定性分析方面，择优精选出符合行业发展方向，基本面优秀、成长性好、估值合理等具有良好预期收益的港股通标的公司股票。定量分析方面，根据香港证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合香港市场的因子组合，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。</p> <p>(3) 投资组合优化模型 在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，分别根据 A 股和港股通多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化，构建风险调整后的最优投资组合。</p> <p>(4) 存托凭证的投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述上市境内交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略。(2) 资产支持证券投资策略。(3) 可转换债券及可</p>
--	---

	<p>交换债券投资策略。</p> <p>4、金融衍生品投资/交易策略                      (1) 股指期货交易策略。(2) 股票期权投资策略。(3) 国债期货交易策略。(4) 信用衍生品投资策略。</p> <p>5、融资投资策略</p> <p>6、其他。</p>
业绩比较基准	<p>中证全指指数收益率×75%+中证港股通综合指数收益率(经汇率调整后)×5%+人民币活期存款利率(税后)×20%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金除可投资 A 股外，还可通过港股通机制投资港股通标的股票，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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95559
传真	0755-25832571	021-62701216
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518052	200336
法定代表人	钱龙海	任德奇

### 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、创金合信均益量化选股混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年 6 月 27 日-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	10,784,543.29	12,843,387.73
本期利润	12,443,364.79	9,527,151.78
加权平均基金份额本期利润	0.1565	0.1130
本期加权平均净值利润率	13.16%	10.67%
本期基金份额净值增长率	14.84%	12.74%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	17,266,825.07	13,836,414.93
期末可供分配基金份额利润	0.2947	0.1274
期末基金资产净值	75,856,512.83	122,436,644.31
期末基金份额净值	1.2947	1.1274
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	29.47%	12.74%

##### 2、创金合信均益量化选股混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年 6 月 27 日-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,278,759.99	8,492,230.15
本期利润	5,460,297.46	10,717,485.01
加权平均基金份额本期利润	0.1574	0.1248
本期加权平均净值利润率	13.16%	12.22%
本期基金份额净值增长率	14.27%	12.44%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	7,535,320.60	5,771,721.53
期末可供分配基金份额利润	0.2848	0.1244
期末基金资产净值	33,991,282.02	52,158,684.20
期末基金份额净值	1.2848	1.1244
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	28.48%	12.44%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信均益量化选股混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.67%	0.78%	0.25%	0.80%	-6.92%	-0.02%
过去六个月	10.54%	0.83%	14.88%	0.76%	-4.34%	0.07%
过去一年	14.84%	0.91%	19.78%	0.90%	-4.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	29.47%	1.26%	35.41%	1.11%	-5.94%	0.15%

创金合信均益量化选股混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.78%	0.78%	0.25%	0.80%	-7.03%	-0.02%
过去六个月	10.26%	0.83%	14.88%	0.76%	-4.62%	0.07%
过去一年	14.27%	0.91%	19.78%	0.90%	-5.51%	0.01%
自基金合同生效起至今	28.48%	1.26%	35.41%	1.11%	-6.93%	0.15%

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

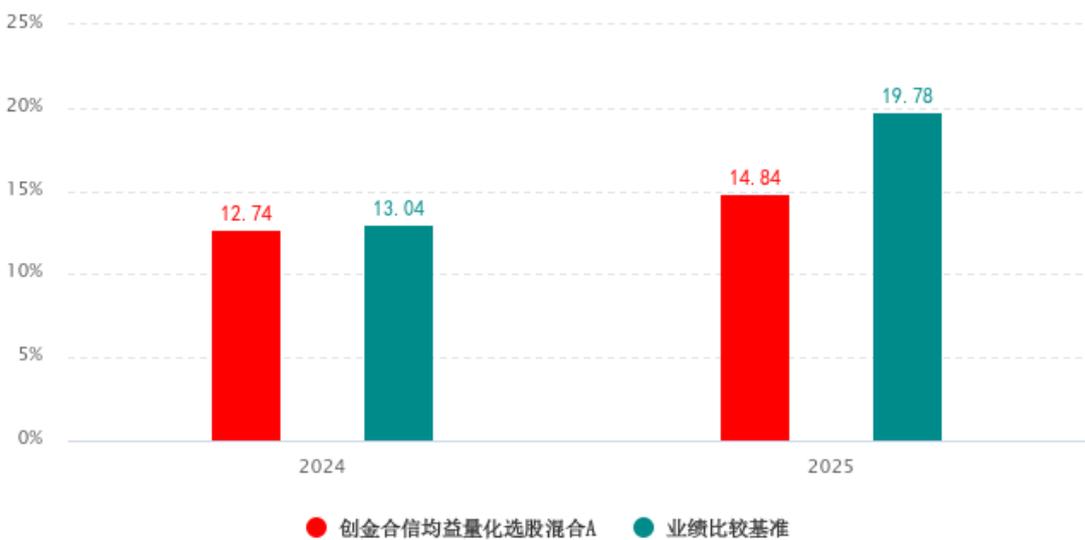
创金合信均益量化选股混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年06月27日-2025年12月31日)

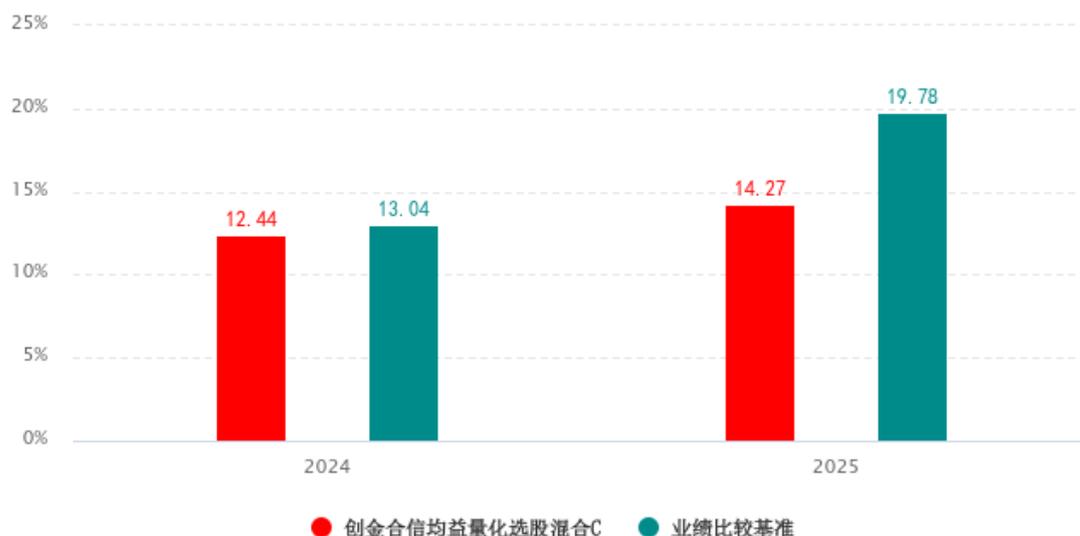


创金合信均益量化选股混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年06月27日-2025年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效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





注：本基金于 2024 年 6 月 27 日成立，截至 2024 年 12 月 31 日基金成立未满 1 年，故成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2024 年 6 月 27 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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		

董梁	本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人	2024年6月27日	-	22	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003年12月加入 UNX Inc 任分析师，2005年3月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009年8月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011年1月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012年8月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015年1月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数部负责人、基金经理。
孙悦	本基金基金经理	2024年6月27日	-	8	孙悦先生，中国国籍，北京大学硕士。2017年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理、兼任投资经理。

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

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

#### 4.1.3 报告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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
孙悦	公募基金	8	6,195,649,998.48	2020-09-09
	私募资产管理计划	2	4,000,633.95	2025-08-29
	其他组合	-	-	-
	合计	10	6,199,650,632.43	-

本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，孙悦离任产品情况如下：

产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1只，离任时间：2025-12-19。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的薪酬激励不与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩直接挂钩，其薪酬激励主要结合长期投资业绩、合规与风险管理情况等综合评定。

## 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 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，国内外宏观环境整体平稳。海外方面，特朗普正式入主白宫，开启针对多个国家的贸易谈判。美国经济总体平稳，通胀水平整体下行，AI 产业持续繁荣，但就业市场活跃度回落，消费者信心有一定降低，体现出美国经济目前有一定的结构性矛盾。美联储实施了多次降息动作。国内方面，经济整体呈现平稳增长态势，工业增加值持续增长，消费、出口保持韧性。中央经济工作会议召开，强调要实施更加积极有为的宏观政策，增强政策前瞻性针对性协同性，为经济工作指明方向。大类资产方面，原油价格下跌，黄金价格上涨，美元指数下跌，美股指数上涨。国内市场行情方面，主要指数上涨，成交额提高，科技、小市值风格涨幅较大。

均益量化选股基金，是一只采用主动量化选股策略的基金，采用红利质量投资策略，以多策略配置的形式进行投资。经济具有周期性，市场风格也具有周期性，不同风格、行业的单一策略在不同市场环境中表现差异巨大，造成投资组合波动性较大。采用多个长期有效、同时低相关的策略进行配置投资，可以显著降低组合整体的波动，提高组合对不同环境的适应能力。对于股票来说，估值和成长性是最重要的考量因素，对于投资策略来说，同时兼顾价值与成长两种风格，是应对未来市场变化的有效策略。均益量化基金采用红利+质量的投资策略，在估值保护的前提下，追求高质量的业绩增长，力争在长期维度下获得稳健可持续的投资收益。产品运作层面，采用多策略+组合优化的模式，在保持对于基准指数较小偏离的同时，对各策略进行积极配置，力争获得可持续的超额收益。

2025 年全年来看，红利质量指数中的部分科技、制造个股上涨较多，带动指数上行。本年度，对成长风格的策略进行了小幅超配，在后市中会根据市场变化调整各类策略的配置比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信均益量化选股混合 A 基金份额净值为 1.2947 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.84%，同期业绩比较基准收益率为 19.78%；截至本报告期末创金合信均益量化选股混合 C 基金份额净值为 1.2848 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.27%，同期业绩比较基准收益率为 19.78%。

#### 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，海外方面，美国经济总体平稳，通胀水平回落，美联储仍然处于降息通道，预计美联储主席换届后货币政策基调更为宽松。国内方面，作为“十五五”规划的开局之年，中国经济将持续高质量发展，在结构优化中保持稳健增长，科技创新将继续引领新质生产力发展。经济政策方面，预计财政政策更加积极，货币政策保持宽松，推动宏观经济持续复苏。

股市方面，由于 2025 年市场整体赚钱效应良好，目前市场指数趋势良好，因此预计 2026 年资金仍然有较强的投资意愿。同时，随着宏观经济复苏，上市公司盈利能力有所修复，对市场估值形成支撑。从结构来看，周期+成长是目前市场的共识方向，随着经济进一步复苏，预计与宏观经济强相关的板块有进一步估值修复的空间。长期来看，如没有大型超预期利空事件出现，市场趋势有望延续。

#### 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

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

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

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

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

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

## § 6 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 2602292 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	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的创金合信均益量化选股混合型证券投资基金(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。 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

	<p>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按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
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：创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

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	4,763,950.99	3,591,221.71

结算备付金		1,646,284.33	1,001,534.76
存出保证金		10,510,778.14	10,700,992.47
交易性金融资产	7.4.7.2	93,261,368.46	156,567,817.85
其中：股票投资		93,261,368.46	156,567,817.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,880.88	3,097,786.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		110,191,262.80	174,959,353.63
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		35,018.91	32,656.71
应付管理人报酬		116,257.59	172,833.67
应付托管费		19,376.28	28,805.60
应付销售服务费		14,757.28	21,691.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	158,057.89	108,037.36
负债合计		343,467.95	364,025.12
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	85,045,649.18	154,987,192.05

其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	24,802,145.67	19,608,136.46
净资产合计		109,847,794.85	174,595,328.51
负债和净资产总计		110,191,262.80	174,959,353.63

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，创金合信均益量化选股混合 A 份额净值 1.2947 元，基金份额总额 58,589,687.76 份；创金合信均益量化选股混合 C 份额净值 1.2848 元，基金份额总额 26,455,961.42 份；总份额合计 85,045,649.18 份。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

本报告期：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 6 月 27 日（基金合同生 效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		20,186,706.71	21,831,010.51
1.利息收入		60,150.80	185,861.55
其中：存款利息收入	7.4.7.9	60,150.80	185,861.55
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）		17,935,996.35	22,206,549.36
其中：股票投资收益	7.4.7.10	15,158,042.76	21,295,248.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	128.75
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-370,295.01	-
股利收益	7.4.7.15	3,148,248.60	911,172.56
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	1,840,358.97	-1,090,981.09

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	350,200.59	529,580.69
减：二、营业总支出		2,283,044.46	1,586,373.72
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,642,578.79	1,076,296.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	273,763.12	179,382.76
3.销售服务费	7.4.10.2.3	208,702.55	222,094.03
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	158,000.00	108,600.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,903,662.25	20,244,636.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,903,662.25	20,244,636.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,903,662.25	20,244,636.79

注：本基金合同生效日为 2024 年 6 月 27 日，上年度可比期间为 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：创金合信均益量化选股混合型证券投资基金

本报告期：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	154,987,192.05	-	19,608,136.46	174,595,328.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	154,987,192.05	-	19,608,136.46	174,595,328.51

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,941,542.87	-	5,194,009.21	-64,747,533.66
（一）、综合收益总额	-	-	17,903,662.25	17,903,662.25
（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）	-69,941,542.87	-	-12,709,653.04	-82,651,195.91
其中：1.基金申购款	95,173,546.24	-	20,603,753.20	115,777,299.44
2.基金赎回款	-165,115,089.11	-	-33,313,406.24	-198,428,495.35
（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	85,045,649.18	-	24,802,145.67	109,847,794.85
项目	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	238,324,294.95	-	-	238,324,294.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-83,337,102.90	-	19,608,136.46	-63,728,966.44
（一）、综合收益总额	-	-	20,244,636.79	20,244,636.79
（二）、本期基金	-83,337,102.90	-	-636,500.33	-83,973,603.23

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	141,187,687.51	-	19,903,927.59	161,091,615.10
2.基金赎回款	-224,524,790.41	-	-20,540,427.92	-245,065,218.33
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	154,987,192.05	-	19,608,136.46	174,595,328.51

注: 本基金合同生效日为 2024 年 6 月 27 日, 上年度可比期间为 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日。

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

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

本基金于 2024 年 5 月 20 日至 2024 年 6 月 25 日募集, 募集期间净认购资金人民币 238,228,208.50 元, 认购资金在募集期间产生的利息人民币 96,086.45 元, 募集的有效认

购份额及利息结转的基金份额合计 238,324,294.95 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第 2400118 号验资报告。

根据《创金合信均益量化选股混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费,但不计提销售服务费的基金份额类别为 A 类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用不同,本基金不同类别的基金份额将分别计算并公告各类基金份额的基金份额净值,计算公式如下:T 日某类基金份额的基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值 / T 日该类基金份额的基金份额余额总数。

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

#### 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。

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) 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；

(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；

(e) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### 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	4,763,950.99	3,591,221.71
等于：本金	4,763,441.63	3,590,249.04
加：应计利息	509.36	972.67
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	4,763,950.99	3,591,221.71
----	--------------	--------------

#### 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		92,511,990.58	-	93,261,368.46	749,377.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		92,511,990.58	-	93,261,368.46	749,377.88
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		157,658,798.94	-	156,567,817.85	-1,090,981.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		157,658,798.94	-	156,567,817.85	-1,090,981.09

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 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	57.89	37.36
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	158,000.00	108,000.00
合计	158,057.89	108,037.36

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信均益量化选股混合 A		
项目	本期 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	108,600,229.38	108,600,229.38
本期申购	84,636,232.15	84,636,232.15
本期赎回（以“-”号填列）	-134,646,773.77	-134,646,773.77
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	58,589,687.76	58,589,687.76

创金合信均益量化选股混合 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	46,386,962.67	46,386,962.67
本期申购	10,537,314.09	10,537,314.09
本期赎回（以“-”号填列）	-30,468,315.34	-30,468,315.34
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	26,455,961.42	26,455,961.42

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

创金合信均益量化选股混合 A
----------------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,101,679.76	-7,265,264.83	13,836,414.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,101,679.76	-7,265,264.83	13,836,414.93
本期利润	10,784,543.29	1,658,821.50	12,443,364.79
本期基金份额交易产生的变动数	-9,891,790.81	878,836.16	-9,012,954.65
其中：基金申购款	21,618,781.87	-3,067,035.27	18,551,746.60
基金赎回款	-31,510,572.68	3,945,871.43	-27,564,701.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,994,432.24	-4,727,607.17	17,266,825.07

创金合信均益量化选股混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,866,260.91	-3,094,539.38	5,771,721.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,866,260.91	-3,094,539.38	5,771,721.53
本期利润	5,278,759.99	181,537.47	5,460,297.46
本期基金份额交易产生的变动数	-4,487,095.79	790,397.40	-3,696,698.39
其中：基金申购款	2,407,332.32	-355,325.72	2,052,006.60
基金赎回款	-6,894,428.11	1,145,723.12	-5,748,704.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,657,925.11	-2,122,604.51	7,535,320.60

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	19,161.57	141,074.85
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	15,044.58	1,534.76
其他	25,944.65	43,251.94
合计	60,150.80	185,861.55

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,158,042.76	21,295,248.05
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	15,158,042.76	21,295,248.05

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	985,487,253.85	448,928,790.99
减：卖出股票成本总额	968,880,895.97	426,886,503.70
减：交易费用	1,448,315.12	747,039.24
买卖股票差价收入	15,158,042.76	21,295,248.05

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	-	214.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-86.04
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	-	128.75

##### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到	-	1,016,416.41

期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	-	1,001,250.00
减: 应计利息总额	-	15,250.41
减: 交易费用	-	2.04
买卖债券差价收入	-	-86.04

#### 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 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
期货投资	-370,295.01	-

#### 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 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,148,248.60	911,172.56
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	3,148,248.60	911,172.56

#### 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	上年度可比期间 2024 年 6 月
------	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,840,358.97	-1,090,981.09
——股票投资	1,840,358.97	-1,090,981.09
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,840,358.97	-1,090,981.09

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	349,770.60	529,543.89
转换费收入	429.99	36.80
合计	350,200.59	529,580.69

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	-	600.00
合计	158,000.00	108,600.00

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至
----	-------------------------------------	-----------------------------------

		2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,642,578.79	1,076,296.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	804,508.23	530,477.27
应支付基金管理人的净管理费	838,070.56	545,819.66

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	273,763.12	179,382.76

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

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

#### 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		
	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C	合计
创金合信直销	-	253.88	253.88
交通银行	-	83,923.60	83,923.60
合计	-	84,177.48	84,177.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C	合计
创金合信直销	-	29.74	29.74
交通银行	-	127,894.85	127,894.85
合计	-	127,924.59	127,924.59

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

销售服务费费率优惠（如有），请见产品公告。

#### 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 6 月 27 日（基金合同生效日）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
交通银行股份有限公司	4,763,950.99	19,161.57	3,591,221.71	141,074.85

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

**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	27,565	87,656.70	172,005.60	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	1-6 个月（含）	新股锁定	114.28	416.18	74	8,456.72	30,797.32	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	1-6 个月（含）	新股锁定	8.62	18.36	1,520	13,102.40	27,907.20	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	1-6 个月（含）	新股锁定	8.45	24.28	701	5,923.45	17,020.28	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	1-6 个月（含）	新股锁定	17.78	25.11	504	8,961.12	12,655.44	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	1-6 个月（含）	新股锁定	14.99	34.87	159	2,383.41	5,544.33	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	1-6 个月（含）	新股锁定	18.58	32.37	135	2,508.30	4,369.95	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	1-6 个月（含）	新股锁定	26.68	42.25	93	2,481.24	3,929.25	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	1-6 个月（含）	新股锁定	10.88	28.10	117	1,272.96	3,287.70	-

		日								
603175	超颖电子	2025年10月17日	1-6个月(含)	新股锁定	17.08	48.56	62	1,058.96	3,010.72	-
603406	天富龙	2025年7月30日	1-6个月(含)	新股锁定	23.60	40.16	52	1,227.20	2,088.32	-
603370	华新精科	2025年8月27日	1-6个月(含)	新股锁定	18.60	46.35	43	799.80	1,993.05	-
603376	大明电子	2025年10月28日	1-6个月(含)	新股锁定	12.55	26.21	75	941.25	1,965.75	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	1-6个月(含)	新股锁定	10.10	16.30	109	1,100.90	1,776.70	-
603418	友升股份	2025年9月16日	1-6个月(含)	新股锁定	46.36	59.06	28	1,298.08	1,653.68	-
603092	德力佳	2025年10月30日	1-6个月(含)	新股锁定	46.68	55.66	26	1,213.68	1,447.16	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	1-6个月(含)	新股锁定	24.49	32.82	40	979.60	1,312.80	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微	2025年12	重大	283.7	2026	278.00	600	165,010.77	170,256.00	-

	公司	月 19 日	事项 停牌	6	年 1 月 5 日					
--	----	--------	----------	---	-----------------	--	--	--	--	--

### 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

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。

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

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

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 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，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。

#### 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	4,763,950.99	-	-	-	4,763,950.99
结算备付金	1,646,284.33	-	-	-	1,646,284.33
存出保证金	10,510,778.14	-	-	-	10,510,778.14
交易性金融资产	-	-	-	93,261,368.46	93,261,368.46
应收申购款	-	-	-	8,880.88	8,880.88
资产总计	16,921,013.46	-	-	93,270,249.34	110,191,262.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,018.91	35,018.91
应付管理人报酬	-	-	-	116,257.59	116,257.59
应付托管费	-	-	-	19,376.28	19,376.28
应付销售服务费	-	-	-	14,757.28	14,757.28
其他负债	-	-	-	158,057.89	158,057.89
负债总计	-	-	-	343,467.95	343,467.95
利率敏感度缺口	16,921,013.46	-	-	92,926,781.39	109,847,794.85
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	3,591,221.71	-	-	-	3,591,221.71
结算备付金	1,001,534.76	-	-	-	1,001,534.76
存出保证金	10,700,992.47	-	-	-	10,700,992.47
交易性金融资产	-	-	-	156,567,817.85	156,567,817.85

应收申购款	-	-	-	3,097,786.84	3,097,786.84
资产总计	15,293,748.94	-	-	159,665,604.69	174,959,353.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,656.71	32,656.71
应付管理人报酬	-	-	-	172,833.67	172,833.67
应付托管费	-	-	-	28,805.60	28,805.60
应付销售服务费	-	-	-	21,691.78	21,691.78
其他负债	-	-	-	108,037.36	108,037.36
负债总计	-	-	-	364,025.12	364,025.12
利率敏感度缺口	15,293,748.94	-	-	159,301,579.57	174,595,328.51

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 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	93,261,368.46	84.90	156,567,817.85	89.67
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	93,261,368.46	84.90	156,567,817.85	89.67

#### 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%	4,327,327.50	9,218,713.12
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,327,327.50	-9,218,713.12

#### 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	92,798,347.21	156,567,817.85
第二层次	170,256.00	-
第三层次	292,765.25	-
合计	93,261,368.46	156,567,817.85

#### 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	-	141,365.77	141,365.77
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	151,399.48	151,399.48
其中：计入损益的利得或损失	-	151,399.48	151,399.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	292,765.25	292,765.25
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	-	151,399.48	151,399.48
项目	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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	292,765.25	平均价格亚式期权模型	预期波动率	16.28%-295.88%	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	93,261,368.46	84.64
	其中：股票	93,261,368.46	84.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,410,235.32	5.82
8	其他各项资产	10,519,659.02	9.55
9	合计	110,191,262.80	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	1,811,194.00	1.65
C	制造业	60,177,583.22	54.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,195,129.37	3.82
E	建筑业	1,981,225.50	1.80
F	批发和零售业	1,767,984.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	2,198,185.00	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,652,519.96	7.88
J	金融业	6,853,219.00	6.24
K	房地产业	1,127,147.00	1.03
L	租赁和商务服务业	1,115,610.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	1,614,491.41	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	880,351.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	63,684.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	823,045.00	0.75
S	综合	-	-

合计	93,261,368.46	84.90
----	---------------	-------

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

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	603232	格尔软件	31,700	727,515.00	0.66
2	688772	珠海冠宇	32,600	701,878.00	0.64
3	603444	吉比特	1,500	635,775.00	0.58
4	688131	皓元医药	8,602	620,032.16	0.56
5	603999	读者传媒	87,700	616,531.00	0.56
6	601608	中信重工	90,900	599,031.00	0.55
7	688097	博众精工	15,800	596,450.00	0.54
8	688662	富信科技	11,600	594,500.00	0.54
9	600236	桂冠电力	73,200	573,156.00	0.52
10	603969	银龙股份	56,300	569,193.00	0.52
11	688548	广钢气体	38,400	558,336.00	0.51
12	688378	奥来德	20,000	546,000.00	0.50
13	688249	晶合集成	16,400	544,316.00	0.50
14	603259	药明康德	6,000	543,840.00	0.50
15	601995	中金公司	15,400	539,000.00	0.49
16	688041	海光信息	2,400	538,584.00	0.49
17	601717	中创智领	21,800	535,190.00	0.49
18	300570	太辰光	4,600	531,530.00	0.48
19	688678	福立旺	21,600	522,288.00	0.48
20	600298	安琪酵母	11,800	516,132.00	0.47
21	601138	工业富联	8,300	515,015.00	0.47
22	601919	中远海控	33,900	514,602.00	0.47
23	603211	晋拓股份	22,100	498,355.00	0.45
24	000680	山推股份	41,400	495,558.00	0.45
25	603233	大参林	28,100	495,122.00	0.45
26	002284	亚太股份	32,400	483,732.00	0.44
27	000959	首钢股份	98,400	482,160.00	0.44
28	605208	永茂泰	35,400	480,732.00	0.44
29	002780	三夫户外	33,400	479,624.00	0.44
30	002562	兄弟科技	74,200	479,332.00	0.44
31	002956	西麦食品	17,000	478,040.00	0.44
32	688103	国力电子	7,800	472,602.00	0.43

33	601601	中国太保	11,200	469,392.00	0.43
34	603966	法兰泰克	39,300	467,670.00	0.43
35	601211	国泰海通	22,700	466,485.00	0.42
36	000852	石化机械	64,100	466,007.00	0.42
37	301191	菲菱科思	4,300	462,336.00	0.42
38	688017	绿的谐波	2,400	461,040.00	0.42
39	600057	厦门象屿	54,100	460,932.00	0.42
40	605128	上海沿浦	12,500	460,750.00	0.42
41	600168	武汉控股	89,800	457,082.00	0.42
42	688690	纳微科技	17,648	455,494.88	0.41
43	688025	杰普特	3,200	453,024.00	0.41
44	688508	芯朋微	7,400	450,660.00	0.41
45	001231	农心科技	18,000	448,920.00	0.41
46	603185	弘元绿能	14,700	448,350.00	0.41
47	603606	东方电缆	7,500	448,125.00	0.41
48	600406	国电南瑞	19,800	445,104.00	0.41
49	600889	南京化纤	26,200	442,780.00	0.40
50	603015	弘讯科技	34,900	437,995.00	0.40
51	688235	百济神州	1,600	429,760.00	0.39
52	688095	福昕软件	4,800	428,496.00	0.39
53	600970	中材国际	41,100	427,029.00	0.39
54	688550	瑞联新材	9,400	425,914.00	0.39
55	603332	苏州龙杰	30,600	424,728.00	0.39
56	603929	亚翔集成	4,429	422,969.50	0.39
57	603993	洛阳钼业	21,100	422,000.00	0.38
58	000006	深振业 A	42,200	419,890.00	0.38
59	600178	东安动力	32,700	418,233.00	0.38
60	600011	华能国际	55,800	416,268.00	0.38
61	600378	昊华科技	13,000	415,480.00	0.38
62	600650	锦江在线	27,300	414,960.00	0.38
63	600801	华新建材	16,900	414,726.00	0.38
64	603299	苏盐井神	39,800	414,716.00	0.38
65	603365	水星家纺	19,700	414,488.00	0.38
66	603390	通达电气	31,700	414,319.00	0.38
67	601628	中国人寿	9,100	414,050.00	0.38
68	688439	振华风光	6,400	413,440.00	0.38
69	601997	贵阳银行	70,300	412,661.00	0.38
70	600315	上海家化	18,300	412,116.00	0.38
71	002886	沃特股份	18,900	410,508.00	0.37
72	002225	濮耐股份	72,000	410,400.00	0.37
73	601881	中国银河	26,100	410,292.00	0.37
74	600095	湘财股份	37,000	409,220.00	0.37
75	603912	佳力图	47,700	408,789.00	0.37

76	603296	华勤技术	4,500	408,330.00	0.37
77	600507	方大特钢	69,300	408,177.00	0.37
78	601108	财通证券	46,800	408,096.00	0.37
79	601865	福莱特	26,000	407,420.00	0.37
80	605018	长华集团	35,100	406,458.00	0.37
81	601991	大唐发电	116,200	405,538.00	0.37
82	601177	杭齿前进	23,300	404,255.00	0.37
83	605305	中际联合	9,700	404,102.00	0.37
84	000626	远大控股	50,800	402,844.00	0.37
85	603082	北自科技	10,900	402,210.00	0.37
86	688183	生益电子	4,200	401,898.00	0.37
87	600318	新力金融	44,700	401,406.00	0.37
88	688138	清溢光电	14,200	399,872.00	0.36
89	688213	思特威	4,201	399,473.09	0.36
90	600602	云赛智联	21,300	398,097.00	0.36
91	300083	创世纪	43,100	396,951.00	0.36
92	300976	达瑞电子	6,600	396,462.00	0.36
93	600794	保税科技	100,900	393,510.00	0.36
94	688059	华锐精密	5,000	393,500.00	0.36
95	002171	楚江新材	29,500	391,170.00	0.36
96	603693	江苏新能	32,800	389,008.00	0.35
97	301079	邵阳液压	12,300	388,803.00	0.35
98	600081	东风科技	32,700	386,841.00	0.35
99	603955	大千生态	13,300	385,833.00	0.35
100	688498	源杰科技	600	385,194.00	0.35
101	688200	华峰测控	2,000	380,400.00	0.35
102	301525	儒竞科技	4,400	379,896.00	0.35
103	002293	罗莱生活	36,900	378,963.00	0.34
104	300389	艾比森	23,300	378,159.00	0.34
105	600979	广安爱众	85,000	373,150.00	0.34
106	300138	晨光生物	29,400	364,854.00	0.33
107	300763	锦浪科技	5,100	364,191.00	0.33
108	002736	国信证券	27,700	363,424.00	0.33
109	002925	盈趣科技	21,400	362,516.00	0.33
110	000619	海螺新材	57,300	355,833.00	0.32
111	000600	建投能源	41,100	350,583.00	0.32
112	300607	拓斯达	10,300	339,282.00	0.31
113	002404	嘉欣丝绸	48,300	338,583.00	0.31
114	002993	奥海科技	7,600	332,196.00	0.30
115	002757	南兴股份	17,000	330,990.00	0.30
116	300817	双飞集团	15,500	328,755.00	0.30
117	600322	津投城开	140,400	327,132.00	0.30
118	601899	紫金矿业	9,400	324,018.00	0.29

119	688686	奥普特	2,600	322,738.00	0.29
120	300386	飞天诚信	17,800	321,468.00	0.29
121	003040	楚天龙	15,500	320,540.00	0.29
122	300674	宇信科技	13,200	320,232.00	0.29
123	300276	三丰智能	32,800	318,160.00	0.29
124	300546	雄帝科技	12,100	316,899.00	0.29
125	600543	莫高股份	59,200	314,352.00	0.29
126	600170	上海建工	118,300	313,495.00	0.29
127	300454	深信服	2,700	310,932.00	0.28
128	300879	大叶股份	10,400	310,440.00	0.28
129	300872	天阳科技	15,000	308,400.00	0.28
130	300180	华峰超纤	44,400	307,692.00	0.28
131	002427	尤夫股份	45,700	306,647.00	0.28
132	301208	中亦科技	7,700	305,536.00	0.28
133	300926	博俊科技	9,300	304,854.00	0.28
134	300333	兆日科技	26,500	304,750.00	0.28
135	002094	青岛金王	39,800	304,470.00	0.28
136	001211	双枪科技	11,500	304,060.00	0.28
137	002123	梦网科技	25,000	304,000.00	0.28
138	000776	广发证券	13,800	303,876.00	0.28
139	002452	长高电新	36,800	302,864.00	0.28
140	000800	一汽解放	44,600	302,388.00	0.28
141	603156	养元饮品	10,500	301,875.00	0.27
142	000902	新洋丰	19,300	301,466.00	0.27
143	300041	回天新材	27,000	299,160.00	0.27
144	301202	朗威股份	7,400	298,960.00	0.27
145	300380	安硕信息	7,200	297,864.00	0.27
146	301607	富特科技	7,400	296,814.00	0.27
147	300399	天利科技	11,700	296,595.00	0.27
148	301310	鑫宏业	6,900	296,355.00	0.27
149	002436	兴森科技	13,900	294,263.00	0.27
150	300438	鹏辉能源	5,500	292,710.00	0.27
151	002942	新农股份	15,200	292,144.00	0.27
152	301096	百诚医药	5,100	291,414.00	0.27
153	000948	南天信息	16,200	290,790.00	0.26
154	002668	TCL 智家	27,900	289,602.00	0.26
155	002917	金奥博	21,600	289,008.00	0.26
156	300853	申昊科技	13,900	288,008.00	0.26
157	601318	中国平安	4,200	287,280.00	0.26
158	002730	电光科技	19,100	287,264.00	0.26
159	000795	英洛华	28,700	286,139.00	0.26
160	600415	小商品城	17,700	282,315.00	0.26
161	002401	中远海科	17,500	278,775.00	0.25

162	000541	佛山照明	45,700	274,657.00	0.25
163	688371	菲沃泰	14,800	273,356.00	0.25
164	603916	苏博特	28,600	270,556.00	0.25
165	000970	中科三环	19,600	265,776.00	0.24
166	002449	国星光电	31,400	265,644.00	0.24
167	600871	石化油服	122,800	265,248.00	0.24
168	002577	雷柏科技	14,800	263,588.00	0.24
169	603700	宁水集团	19,000	258,210.00	0.24
170	600704	物产中大	46,000	256,220.00	0.23
171	001339	智微智能	5,000	255,550.00	0.23
172	603132	金徽股份	17,400	255,258.00	0.23
173	603858	步长制药	15,700	245,548.00	0.22
174	300047	天源迪科	19,200	240,960.00	0.22
175	600159	大龙地产	86,100	238,497.00	0.22
176	600660	福耀玻璃	3,600	233,172.00	0.21
177	603880	南卫股份	37,300	232,379.00	0.21
178	300496	中科创达	3,400	229,500.00	0.21
179	603281	江瀚新材	8,100	224,775.00	0.20
180	002287	奇正藏药	9,382	221,978.12	0.20
181	688002	睿创微纳	2,200	221,760.00	0.20
182	600873	梅花生物	21,800	220,834.00	0.20
183	600956	新天绿能	29,900	216,775.00	0.20
184	688055	龙腾光电	59,800	215,280.00	0.20
185	603979	金诚信	2,800	213,220.00	0.19
186	600030	中信证券	7,400	212,454.00	0.19
187	601900	南方传媒	15,400	206,514.00	0.19
188	603173	福斯达	4,600	196,972.00	0.18
189	002422	科伦药业	6,700	196,645.00	0.18
190	688528	秦川物联	18,200	196,014.00	0.18
191	600900	长江电力	7,200	195,768.00	0.18
192	600820	隧道股份	29,800	193,402.00	0.18
193	601066	中信建投	7,200	192,744.00	0.18
194	002641	公元股份	44,600	192,672.00	0.18
195	600983	惠而浦	20,100	192,156.00	0.17
196	688067	爱威科技	7,800	191,568.00	0.17
197	000637	茂化实华	44,300	190,490.00	0.17
198	002625	光启技术	3,800	185,288.00	0.17
199	603568	伟明环保	7,300	185,274.00	0.17
200	603886	元祖股份	13,200	184,404.00	0.17
201	002976	瑞玛精密	6,500	182,195.00	0.17
202	600930	华电新能	28,978	180,893.37	0.16
203	000755	山西高速	35,900	180,218.00	0.16
204	688726	拉普拉斯	5,000	180,000.00	0.16

205	600690	海尔智家	6,700	174,803.00	0.16
206	688019	安集科技	800	174,336.00	0.16
207	600959	江苏有线	50,400	173,376.00	0.16
208	002983	芯瑞达	7,500	172,125.00	0.16
209	688012	中微公司	600	170,256.00	0.15
210	000050	深天马 A	18,600	167,958.00	0.15
211	603558	健盛集团	14,900	167,327.00	0.15
212	603833	欧派家居	3,200	166,688.00	0.15
213	603345	安井食品	2,100	166,488.00	0.15
214	001216	华瓷股份	9,600	164,256.00	0.15
215	300032	金龙机电	30,400	163,248.00	0.15
216	688728	格科微	10,800	161,352.00	0.15
217	605499	东鹏饮料	600	160,434.00	0.15
218	600388	龙净环保	9,800	159,838.00	0.15
219	688799	华纳药厂	3,330	158,841.00	0.14
220	600096	云天化	4,700	157,027.00	0.14
221	601330	绿色动力	23,000	154,790.00	0.14
222	600572	康恩贝	34,600	154,316.00	0.14
223	000058	深赛格	16,400	154,160.00	0.14
224	688105	诺唯赞	7,600	152,152.00	0.14
225	600210	紫江企业	20,500	150,675.00	0.14
226	601528	瑞丰银行	26,200	149,340.00	0.14
227	601065	江盐集团	17,800	147,740.00	0.13
228	600269	赣粤高速	28,400	147,396.00	0.13
229	688391	钜泉科技	5,200	147,316.00	0.13
230	688270	臻镭科技	1,200	146,484.00	0.13
231	000623	吉林敖东	7,500	146,475.00	0.13
232	600012	皖通高速	9,800	145,236.00	0.13
233	603043	广州酒家	8,200	144,566.00	0.13
234	601827	三峰环境	17,000	143,990.00	0.13
235	600958	东方证券	13,200	143,880.00	0.13
236	603948	建业股份	5,200	141,960.00	0.13
237	601163	三角轮胎	9,900	141,471.00	0.13
238	002987	京北方	6,400	137,792.00	0.13
239	603486	科沃斯	1,700	137,156.00	0.12
240	603167	渤海轮渡	14,200	133,906.00	0.12
241	688188	柏楚电子	983	133,579.87	0.12
242	300105	龙源技术	18,500	132,460.00	0.12
243	688450	光格科技	4,800	132,384.00	0.12
244	688595	芯海科技	4,000	131,200.00	0.12
245	300074	华平股份	28,200	130,002.00	0.12
246	603519	立霸股份	10,700	128,721.00	0.12
247	600662	外服控股	25,400	127,508.00	0.12

248	600749	西藏旅游	7,400	126,392.00	0.12
249	603856	东宏股份	10,000	124,700.00	0.11
250	603378	亚士创能	18,300	124,623.00	0.11
251	600160	巨化股份	3,200	122,944.00	0.11
252	600019	宝钢股份	16,500	122,925.00	0.11
253	600031	三一重工	5,800	122,554.00	0.11
254	600036	招商银行	2,900	122,090.00	0.11
255	600201	生物股份	8,100	122,067.00	0.11
256	002043	兔宝宝	8,300	119,603.00	0.11
257	601096	宏盛华源	28,500	118,275.00	0.11
258	002142	宁波银行	4,200	117,978.00	0.11
259	002216	三全食品	10,200	115,158.00	0.10
260	600847	万里股份	9,900	115,038.00	0.10
261	601766	中国中车	16,800	114,576.00	0.10
262	300357	我武生物	4,000	113,400.00	0.10
263	002403	爱仕达	8,800	111,408.00	0.10
264	603019	中科曙光	1,300	111,332.00	0.10
265	603358	华达科技	2,200	111,100.00	0.10
266	603489	八方股份	3,600	110,088.00	0.10
267	688127	蓝特光学	2,832	109,003.68	0.10
268	603726	朗迪集团	4,500	108,900.00	0.10
269	002028	思源电气	700	108,213.00	0.10
270	601166	兴业银行	5,100	107,406.00	0.10
271	688329	艾隆科技	5,000	106,450.00	0.10
272	600016	民生银行	27,600	105,708.00	0.10
273	688366	昊海生科	2,400	105,360.00	0.10
274	600377	宁沪高速	8,700	105,357.00	0.10
275	688466	金科环境	6,400	104,128.00	0.09
276	600015	华夏银行	15,100	103,737.00	0.09
277	300798	锦鸡股份	14,500	103,095.00	0.09
278	688410	山外山	6,850	102,544.50	0.09
279	600195	中牧股份	13,000	102,310.00	0.09
280	600578	京能电力	20,000	102,000.00	0.09
281	000815	美利云	9,100	101,829.00	0.09
282	600262	北方股份	3,900	101,517.00	0.09
283	688677	海泰新光	2,347	101,296.52	0.09
284	603282	亚光股份	5,100	101,184.00	0.09
285	601808	中海油服	7,200	101,088.00	0.09
286	603818	曲美家居	27,900	100,719.00	0.09
287	600649	城投控股	22,600	100,570.00	0.09
288	688312	燕麦科技	3,016	100,070.88	0.09
289	600919	江苏银行	9,600	99,840.00	0.09
290	600064	南京高科	11,500	99,820.00	0.09

291	688232	新点软件	4,000	99,280.00	0.09
292	688700	东威科技	2,800	98,784.00	0.09
293	600051	宁波联合	13,100	98,774.00	0.09
294	600116	三峡水利	15,100	98,754.00	0.09
295	600999	招商证券	5,900	98,176.00	0.09
296	603529	爱玛科技	3,300	98,010.00	0.09
297	601901	方正证券	12,500	97,500.00	0.09
298	600782	新钢股份	24,900	96,612.00	0.09
299	603639	海利尔	7,600	96,520.00	0.09
300	601512	中新集团	10,700	96,300.00	0.09
301	600027	华电国际	19,400	96,224.00	0.09
302	603937	丽岛新材	8,000	95,920.00	0.09
303	603611	诺力股份	3,900	95,355.00	0.09
304	605028	世茂能源	3,200	94,528.00	0.09
305	688078	龙软科技	3,400	93,500.00	0.09
306	601518	吉林高速	33,000	93,060.00	0.08
307	301198	喜悦智行	7,400	92,944.00	0.08
308	002916	深南电路	400	92,916.00	0.08
309	600025	华能水电	10,200	92,616.00	0.08
310	600372	中航机载	6,900	92,598.00	0.08
311	600867	通化东宝	11,300	92,321.00	0.08
312	300126	锐奇股份	10,700	91,592.00	0.08
313	600941	中国移动	900	90,945.00	0.08
314	601336	新华保险	1,300	90,610.00	0.08
315	688363	华熙生物	2,068	90,330.24	0.08
316	603998	方盛制药	8,000	89,920.00	0.08
317	601688	华泰证券	3,800	89,642.00	0.08
318	600219	南山铝业	16,600	89,308.00	0.08
319	688021	奥福科技	4,800	88,080.00	0.08
320	000951	中国重汽	5,200	87,880.00	0.08
321	688479	友车科技	4,600	86,618.00	0.08
322	600300	维维股份	24,400	85,644.00	0.08
323	601088	中国神华	2,100	85,050.00	0.08
324	603739	蔚蓝生物	6,000	84,900.00	0.08
325	603050	科林电气	4,700	84,694.00	0.08
326	600938	中国海油	2,800	84,504.00	0.08
327	301377	鼎泰高科	600	83,460.00	0.08
328	600162	香江控股	45,100	83,435.00	0.08
329	600425	青松建化	19,800	82,368.00	0.07
330	002027	分众传媒	11,100	81,807.00	0.07
331	002463	沪电股份	1,100	80,377.00	0.07
332	300469	信息发展	1,300	80,340.00	0.07
333	000988	华工科技	1,000	79,330.00	0.07

334	301031	中熔电气	700	78,533.00	0.07
335	300652	雷迪克	1,400	76,804.00	0.07
336	000598	兴蓉环境	10,600	76,002.00	0.07
337	300750	宁德时代	200	73,452.00	0.07
338	688057	金达莱	6,000	73,320.00	0.07
339	600150	中国船舶	2,200	73,172.00	0.07
340	603712	七一二	3,500	72,695.00	0.07
341	002859	洁美科技	2,600	71,760.00	0.07
342	603029	天鹅股份	3,900	71,136.00	0.06
343	603041	美思德	5,900	71,095.00	0.06
344	000828	东莞控股	6,500	69,940.00	0.06
345	002396	星网锐捷	2,300	69,690.00	0.06
346	600809	山西汾酒	400	68,680.00	0.06
347	300274	阳光电源	400	68,416.00	0.06
348	002508	老板电器	3,500	67,725.00	0.06
349	601728	中国电信	10,400	65,520.00	0.06
350	002372	伟星新材	6,200	64,666.00	0.06
351	300015	爱尔眼科	5,800	63,684.00	0.06
352	000895	双汇发展	2,400	63,528.00	0.06
353	688113	联测科技	1,600	63,248.00	0.06
354	603501	豪威集团	500	62,950.00	0.06
355	000001	平安银行	5,500	62,755.00	0.06
356	002824	和胜股份	3,200	62,080.00	0.06
357	600768	宁波富邦	4,400	61,600.00	0.06
358	600918	中泰证券	9,400	61,100.00	0.06
359	601168	西部矿业	2,200	60,808.00	0.06
360	601818	光大银行	17,300	60,377.00	0.05
361	603025	大豪科技	3,300	59,268.00	0.05
362	600456	宝钛股份	1,500	59,175.00	0.05
363	002475	立讯精密	1,000	56,710.00	0.05
364	601677	明泰铝业	3,700	54,723.00	0.05
365	002557	洽洽食品	2,500	54,050.00	0.05
366	603206	嘉环科技	3,100	53,599.00	0.05
367	600496	精工钢构	12,700	52,705.00	0.05
368	000166	申万宏源	10,000	52,700.00	0.05
369	688377	迪威尔	1,400	51,380.00	0.05
370	300614	百川畅银	3,900	49,452.00	0.05
371	603236	移远通信	500	47,705.00	0.04
372	002996	顺博合金	6,000	45,360.00	0.04
373	002033	丽江股份	4,700	43,005.00	0.04
374	300628	亿联网络	1,100	39,215.00	0.04
375	001286	陕西能源	4,200	39,102.00	0.04
376	002311	海大集团	700	38,766.00	0.04

377	300206	理邦仪器	3,000	38,370.00	0.03
378	000883	湖北能源	8,300	37,682.00	0.03
379	002831	裕同科技	1,300	37,063.00	0.03
380	301015	百洋医药	1,500	35,400.00	0.03
381	300098	高新兴	5,800	35,380.00	0.03
382	300453	三鑫医疗	3,800	33,136.00	0.03
383	000858	五粮液	300	31,782.00	0.03
384	688795	摩尔线程	74	30,797.32	0.03
385	002063	远光软件	5,000	30,350.00	0.03
386	688783	西安奕材	1,520	27,907.20	0.03
387	300831	派瑞股份	2,300	25,346.00	0.02
388	001218	丽臣实业	1,100	25,058.00	0.02
389	001308	康冠科技	1,100	22,946.00	0.02
390	002594	比亚迪	200	19,544.00	0.02
391	688729	屹唐股份	701	17,020.28	0.02
392	000768	中航西飞	600	15,228.00	0.01
393	000423	东阿阿胶	300	14,724.00	0.01
394	301359	东南电子	700	13,384.00	0.01
395	688759	必贝特	504	12,655.44	0.01
396	300079	数码视讯	2,000	10,780.00	0.01
397	002412	汉森制药	1,600	10,256.00	0.01
398	002818	富森美	800	8,888.00	0.01
399	002233	塔牌集团	700	6,307.00	0.01
400	002204	大连重工	800	6,120.00	0.01
401	688727	恒坤新材	159	5,544.33	0.01
402	001326	联域股份	100	4,722.00	0.00
403	688805	健信超导	135	4,369.95	0.00
404	688796	百奥赛图	93	3,929.25	0.00
405	002345	潮宏基	300	3,750.00	0.00
406	603262	技源集团	117	3,287.70	0.00
407	300675	建科院	200	3,124.00	0.00
408	603175	超颖电子	62	3,010.72	0.00
409	002481	双塔食品	500	2,555.00	0.00
410	603406	天富龙	52	2,088.32	0.00
411	603370	华新精科	43	1,993.05	0.00
412	603376	大明电子	75	1,965.75	0.00
413	603248	锡华科技	109	1,776.70	0.00
414	603418	友升股份	28	1,653.68	0.00
415	603092	德力佳	26	1,447.16	0.00
416	603334	丰倍生物	40	1,312.80	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	605499	东鹏饮料	13,551,000.00	7.76
2	688111	金山办公	10,550,399.95	6.04
3	600563	法拉电子	10,257,040.00	5.87
4	300033	同花顺	9,307,995.00	5.33
5	603486	科沃斯	8,790,845.00	5.03
6	688617	惠泰医疗	8,757,154.72	5.02
7	300866	安克创新	8,593,115.00	4.92
8	600519	贵州茅台	8,247,234.00	4.72
9	601336	新华保险	8,075,058.00	4.63
10	603816	顾家家居	7,586,334.70	4.35
11	002594	比亚迪	7,544,166.36	4.32
12	600660	福耀玻璃	7,268,235.00	4.16
13	603444	吉比特	7,260,898.00	4.16
14	000858	五粮液	7,188,667.00	4.12
15	603297	永新光学	6,941,387.00	3.98
16	603259	药明康德	6,709,339.00	3.84
17	300124	汇川技术	6,441,794.00	3.69
18	603393	新天然气	6,434,205.00	3.69
19	002648	卫星化学	6,353,302.00	3.64
20	301031	中熔电气	6,347,917.00	3.64
21	601601	中国太保	6,206,319.00	3.55
22	603688	石英股份	5,817,257.00	3.33
23	603893	瑞芯微	5,530,767.00	3.17
24	000423	东阿阿胶	5,470,606.00	3.13
25	300770	新媒股份	5,406,799.99	3.10
26	002001	新和成	5,343,701.00	3.06
27	000513	丽珠集团	5,284,580.00	3.03
28	603833	欧派家居	5,250,862.00	3.01
29	600887	伊利股份	5,233,192.00	3.00
30	603929	亚翔集成	4,909,893.30	2.81
31	000651	格力电器	4,836,614.00	2.77
32	002311	海大集团	4,827,704.00	2.77
33	688123	聚辰股份	4,555,885.16	2.61
34	601900	南方传媒	4,552,508.00	2.61
35	300373	扬杰科技	4,459,154.00	2.55
36	601919	中远海控	4,439,495.80	2.54
37	002415	海康威视	4,377,961.00	2.51
38	300750	宁德时代	4,072,591.40	2.33

39	688029	南微医学	3,978,344.63	2.28
40	000333	美的集团	3,895,010.00	2.23
41	601318	中国平安	3,869,473.00	2.22
42	600900	长江电力	3,848,480.00	2.20
43	601168	西部矿业	3,761,308.00	2.15
44	600873	梅花生物	3,611,250.00	2.07

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	605499	东鹏饮料	14,570,043.92	8.35
2	603486	科沃斯	12,508,241.60	7.16
3	688111	金山办公	12,439,708.89	7.12
4	300866	安克创新	11,497,777.80	6.59
5	688617	惠泰医疗	10,793,050.48	6.18
6	300033	同花顺	10,667,684.00	6.11
7	600563	法拉电子	10,088,459.00	5.78
8	603259	药明康德	9,712,254.80	5.56
9	603393	新天然气	9,252,699.65	5.30
10	601336	新华保险	9,231,463.00	5.29
11	600519	贵州茅台	9,190,163.00	5.26
12	603816	顾家家居	8,437,140.40	4.83
13	600900	长江电力	8,081,397.00	4.63
14	002594	比亚迪	8,068,661.00	4.62
15	000858	五粮液	7,860,054.00	4.50
16	603297	永新光学	7,737,638.00	4.43
17	600660	福耀玻璃	7,686,912.00	4.40
18	300124	汇川技术	7,577,207.00	4.34
19	603444	吉比特	7,490,982.00	4.29
20	002001	新和成	7,202,300.20	4.13
21	601601	中国太保	6,939,994.00	3.97
22	002648	卫星化学	6,540,033.00	3.75
23	603893	瑞芯微	6,489,298.00	3.72
24	301031	中熔电气	6,361,660.04	3.64
25	000651	格力电器	6,336,586.20	3.63
26	002311	海大集团	6,328,068.00	3.62
27	000513	丽珠集团	6,189,654.00	3.55
28	002128	电投能源	6,187,602.00	3.54
29	000423	东阿阿胶	6,170,622.00	3.53
30	600887	伊利股份	5,911,682.00	3.39
31	603688	石英股份	5,899,087.85	3.38

32	000333	美的集团	5,632,642.00	3.23
33	603929	亚翔集成	5,626,927.00	3.22
34	300373	扬杰科技	5,469,906.00	3.13
35	300770	新媒股份	5,367,424.00	3.07
36	603833	欧派家居	5,339,147.00	3.06
37	002415	海康威视	5,299,299.30	3.04
38	601168	西部矿业	4,920,423.00	2.82
39	601088	中国神华	4,866,025.00	2.79
40	601919	中远海控	4,840,066.00	2.77
41	601225	陕西煤业	4,778,326.00	2.74
42	688123	聚辰股份	4,681,741.36	2.68
43	300705	九典制药	4,675,141.00	2.68
44	300750	宁德时代	4,626,757.00	2.65
45	301061	匠心家居	4,451,769.70	2.55
46	688029	南微医学	4,438,589.64	2.54
47	601318	中国平安	4,207,198.00	2.41
48	601900	南方传媒	4,149,417.00	2.38
49	000895	双汇发展	4,139,232.00	2.37
50	300628	亿联网络	4,034,539.00	2.31
51	300760	迈瑞医疗	3,997,535.00	2.29
52	002821	凯莱英	3,859,254.88	2.21
53	600285	羚锐制药	3,831,353.00	2.19
54	600993	马应龙	3,693,892.98	2.12
55	300347	泰格医药	3,693,712.00	2.12
56	000568	泸州老窖	3,673,961.00	2.10
57	002315	焦点科技	3,533,662.00	2.02

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	903,734,087.61
卖出股票收入（成交）总额	985,487,253.85

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.2 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。

## 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	10,510,778.14

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,880.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,519,659.02

#### 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债券。

#### 8.12.5 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。

#### 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
创金合信均 益量化选股 混合 A	985	59,481.92	0.79	-	58,589,686. 97	100.00%
创金合信均 益量化选股 混合 C	328	80,658.42	-	-	26,455,961. 42	100.00%
合计	1,292	65,824.81	0.79	0.00%	85,045,648. 39	100.00%

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

### 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	创金合信均益量化选股混合 A	353,755.76	0.60%
	创金合信均益量化选股混合 C	41,136.75	0.16%
	合计	394,892.51	0.46%

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的情况

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

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产份额总量的数量区间（万份）
孙悦	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信均益量化选股混合 A	创金合信均益量化选股混合 C
基金合同生效日(2024年6月27日)基金份额总额	94,476,813.37	143,847,481.58
本报告期期初基金份额总额	108,600,229.38	46,386,962.67

本报告期基金总申购份额	84,636,232.15	10,537,314.09
减：本报告期基金总赎回份额	134,646,773.77	30,468,315.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,589,687.76	26,455,961.42

## § 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，孟羽任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

### 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 38,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 2 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,基金托管人未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未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	
中银国际证券	4	1,860,037,107.32	98.48%	821,658.93	98.48%	-

中信建投 证券	4	28,758,140.87	1.52%	12,720.33	1.52%	-
------------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

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等；
- (7) 公司认为需要考虑的其他事项。

2、证券公司及其专用交易单元的选择程序：

- (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。
- (2) 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

3、本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

### 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
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 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	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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

3	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资)、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-11
4	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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
5	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
6	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
7	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26
8	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金(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
9	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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
10	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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
11	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-05
12	创金合信均益量化选股混合型证券投资基金 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
13	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-24

## § 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

本基金本报告期未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同相关约定,本基金股票投资占基金资产的比例上限高于 80%,结合本基金的投资策略和市场情况,本基金股票投资占基金资产的比例可能阶段性或长期高于 80%,将面临着较高的市场波动和投资风险,请投资者充分考虑自身的风险承受能力,理性判断并谨慎作出投资决策。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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