

创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 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：广发证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	40

7.9 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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	43
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	44
10.8 其他重大事件	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创金合信中证国有企业红利 ETF
场内简称	红利国有
基金主代码	563890
交易代码	563890
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 24 日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	25,336,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 10 月 17 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 2% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.20% 以内。 1、股票投资策略 通常情形下，本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。 为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采用包括替代技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。替代是指通过投资其他成份股、非成份股或金融衍生品等金融工具来构建对应的风险敞口。 以上特殊情形包括但不限于：1) 投资组合规模较小，不适合采用完全复制法；2) 法律法规的限制；3) 标的指数成份股因长期停牌等原因导致流动性不足；4) 标的指数的成份股发生分红、配股、增发等行为；5) 标的指数编制方法发生变化；6) 基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响；7) 其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 2、存托凭证的投资策略

	本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 3、固定收益品种投资策略 （1）债券投资策略 本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。 （2）可转换债券及可交换债券投资策略 可转换债券及可交换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。 （3）资产支持证券投资策略 本基金运用定量及定性的分析方法对资产支持证券的利率风险、资产池信用风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 4、衍生产品投资/交易策略 （1）股指期货交易策略。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现交易目标。 （2）股票期权投资策略。本基金参与股票期权交易应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。 （3）国债期货交易策略。为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性，本基金将本着谨慎的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的交易。 5、融资、转融通证券出借业务投资策略 本基金将在法律法规允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资与转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、出借证券流动性等因素的基础上合理确定范围、期限和比例，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。
业绩比较基准	中证国有企业红利指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田	罗琦
	联系电话	0755-82820166	020-66338888
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95575
传真		0755-25832571	020-87553363-6847
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	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码		518052	510627
法定代表人		青美平措	林传辉

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	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	3,118,799.38
本期利润	-556,298.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0158
本期加权平均净值利润率	-1.51%
本期基金份额净值增长率	-6.99%
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	-1,350,359.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0533
期末基金资产净值	23,985,640.16
期末基金份额净值	0.9467
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	-5.33%

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 2025 年 9 月 24 日，无上年度可比期间。

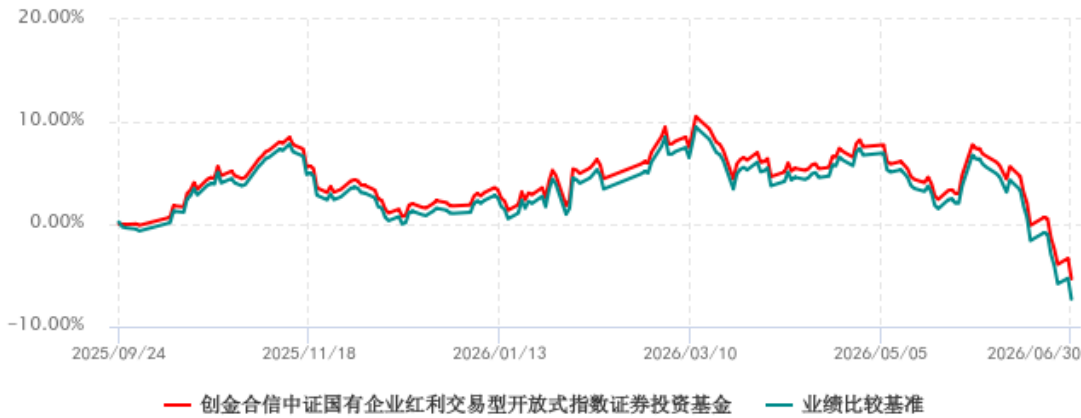
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 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	-10.72%	0.90%	-11.83%	0.93%	1.11%	-0.03%
过去六个月	-6.99%	0.96%	-8.29%	0.98%	1.30%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-5.33%	0.84%	-7.31%	0.86%	1.98%	-0.02%

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

创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年09月24日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2025 年 9 月 24 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		

邵立夫	本基金基金经理	2025 年 9 月 24 日	-	16	邵立夫先生，中国国籍，清华大学硕士研究生，2009 年 8 月加入华泰联合证券有限责任公司，任研究部分析师，2011 年 8 月加入中信证券股份有限公司，历任研究部、销售交易部高级分析师，2013 年 9 月加入上海申银万国证券研究所，任金融工程部高级分析师，2016 年 7 月加入江苏汇鸿汇升投资管理有限公司，任上海分公司投资部量化投资总监，2017 年 4 月加入创金合信基金管理有限公司，任指数与量化投资部总监助理、投资经理，2020 年 9 月加入上海申九资产管理有限公司，任量化投资部量化投资总监，2025 年 3 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理，现任基金经理。
-----	---------	-----------------	---	----	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2026 年上半年，中国经济延续修复态势，经济运行呈现出外部需求改善与政策持续支持共同推动的特征。年初以来，出口表现成为经济运行的重要支撑因素，在全球制造业景气回暖以及外需改善的背景下，我国出口保持较强韧性，制造业产业链优势持续体现。与此同时，国内政策环境保持积极，财政政策加快发力，重点领域投资持续推进；货币政策维持适度宽松取向，流动性合理充裕，为实体经济修复提供支持。基础设施投资保持较快增长，消费需求延续温和恢复，经济内生动能逐步改善。

价格层面，随着国内需求逐步修复以及国际大宗商品价格回升，工业品价格信号有所改善，PPI 转正带动上游行业盈利压力边际缓解，名义增长环境较此前有所改善。但与此同时，经济复苏基础仍需进一步巩固，消费恢复力度和企业盈利改善仍面临一定挑战。

全球市场环境方面，上半年宏观叙事经历了明显变化。年初市场关注重点主要集中于经济修复和政策宽松预期，随后受到地缘政治风险扰动影响，市场风险偏好阶段性下降；随着外部不确定因素逐步缓解，市场风险偏好逐渐回升，A 股市场整体呈现震荡上行走势，成长风格表现相对突出，而红利策略阶段性承压。

从权益市场表现来看，上半年风格切换较为明显。年初在市场波动加剧阶段，具备稳定盈利能力、高股息率和较强防御属性的红利资产表现出较好的抗震荡能力。国企红利指数凭借较为均衡的行业结构以及稳定的现金分红特征，在市场风险偏好下降阶段体现出较强韧性。随着市场环境逐步改善，资金风险偏好提升，配置方向逐渐向高弹性的成长板块倾斜，人工智能、半导体、通信设备、消费电子等科技产业链表现较为突出，而金融、能源等传统红利行业阶段性承压。

本基金紧密跟踪中证国有企业红利指数，该指数主要选取沪深两市国有企业中现金股息率较高、分红稳定，同时具备一定规模和流动性的上市公司，反映国有企业高股息股票的整体表现。投资管理方面，本基金坚持采用完全复制的指数化投资方法，通过量化工具开展精细化管理，严格按照指数成分股构成进行组合配置，并积极应对成分股调整、分红派息等公司行为，通过优化交易策略和执行方式，有效控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

报告期内，本基金始终坚持既定投资策略，保持对标的指数的紧密跟踪，为投资者提供透明、稳定的指数化投资工具。展望未来，市场风格可能在经济基本面、政策环境和资金偏好的共同影响下趋于均衡。虽然成长板块经过阶段上涨后估值有所提升，但红利资产仍具备低估值、高股息和盈利稳定等特征，在中长期资产配置中具有一定吸引力。本基金

将继续坚持指数化投资理念，密切关注指数成分变化、宏观经济环境及市场风格演变，持续做好组合管理和风险控制，力争实现基金净值表现与标的指数的有效跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证国有企业红利 ETF 基金份额净值为 0.9467 元，本报告期内，份额净值增长率为-6.99%，同期业绩比较基准收益率为-8.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济仍可能保持温和增长，但不同经济体之间增长动能、通胀水平和货币政策路径的分化或将进一步显现。人工智能相关产业投资仍有望对全球科技产业链形成支撑，但地缘政治、能源价格及通胀粘性等因素仍可能影响全球流动性环境。整体来看，全球市场或将处于经济韧性与政策不确定性并存的环境中，资产价格波动可能有所增加，市场关注重点将逐步由流动性预期转向企业盈利改善、产业趋势演变以及估值合理性。

国内方面，上半年经济运行总体保持平稳，经济结构转型和新旧动能转换仍在持续推进。高技术制造业、信息技术服务以及部分先进制造领域保持较强景气，而消费恢复、民间投资以及房地产相关需求仍需要进一步改善。预计下半年宏观政策仍将保持支持力度，财政政策和货币政策有望继续协同发力，通过扩大内需、促进产业升级、推动科技创新以及稳定房地产市场等方式巩固经济修复基础。整体来看，国内经济或将延续温和修复态势，但结构分化特征仍将持续。

市场方面，随着政策环境改善、中长期资金持续入市以及资本市场改革深化，A 股市场仍具备一定支撑因素。但在经济全面复苏尚需验证的背景下，市场机会可能继续呈现结构化特征。前期以流动性和产业主题驱动的部分板块在经历上涨后，市场对于盈利兑现能力、估值水平以及长期竞争力的关注度可能进一步提升，行业轮动和风格切换仍可能较为明显。

从产业趋势来看，以人工智能、半导体、通信设备和算力基础设施为代表的新质生产力方向，中长期产业发展趋势仍值得关注。随着产业发展逐步从技术投入阶段向商业化落地阶段推进，市场定价逻辑可能更加关注产业链盈利能力、订单质量、现金流水平以及竞争格局变化。与此同时，具有稳定盈利能力、较强现金流创造能力和持续分红能力的红利资产，在市场波动环境中仍具备一定配置价值。尤其是在成长板块估值水平经历阶段提升后，低估值、高股息、盈利稳定的资产有望继续发挥组合稳定作用。

对于国企红利资产而言，随着资本市场持续推进提高上市公司质量、强化投资者回报机制，具备稳定经营能力和持续分红能力的优质国有企业仍具有长期配置价值。国企红利

指数成分股主要覆盖金融、能源、工业等传统优势领域，行业分布相对均衡，盈利稳定性和分红能力较强，在不同市场环境下具备一定的防御属性和长期配置价值。

本基金将继续坚持指数化投资策略，严格按照基金合同约定跟踪中证国有企业红利指数，通过精细化管理控制跟踪误差和跟踪偏离度。同时，基金管理人将持续关注宏观经济环境、市场风格变化以及指数成分股调整情况，做好组合管理和风险控制，为投资者提供透明、稳定的指数化投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万万元的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告中的财务指标、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：创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	145,264.14	328,015.60
结算备付金		-	-
存出保证金		209,132.58	299,807.23
交易性金融资产	6.4.7.2	23,668,918.80	60,373,087.83
其中：股票投资		23,668,918.80	60,373,087.83
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		24,023,315.52	61,000,910.66
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,797.95	26,541.40
应付托管费		2,177.32	5,898.10
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	25,700.09	64,278.67
负债合计		37,675.36	96,718.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	25,336,000.00	59,836,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,350,359.84	1,068,192.49
净资产合计		23,985,640.16	60,904,192.49
负债和净资产总计		24,023,315.52	61,000,910.66

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9467 元，基金份额总额 25,336,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	-----	------------------------------------

一、营业总收入		-428,911.66
1.利息收入		1,628.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,628.81
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）		3,230,740.32
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,696,632.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	534,108.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,675,097.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,816.81
减：二、营业总支出		127,386.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	83,198.00
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	18,488.47
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.20	25,700.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-556,298.22
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-556,298.22
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-556,298.22

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 24 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,836,000.00	-	1,068,192.49	60,904,192.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	59,836,000.00	-	1,068,192.49	60,904,192.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,500,000.00	-	-2,418,552.33	-36,918,552.33
（一）、综合收益总额	-	-	-556,298.22	-556,298.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-34,500,000.00	-	-1,862,254.11	-36,362,254.11
其中：1.基金申购款	3,500,000.00	-	205,947.80	3,705,947.80
2.基金赎回款	-38,000,000.00	-	-2,068,201.91	-40,068,201.91
（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	25,336,000.00	-	-1,350,359.84	23,985,640.16

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 24 日，无上年度可比期间。

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

创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1736 号《关于准予创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 444,836,000.00 元，经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2500393 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 444,836,000.00 份基金份额，其中有效认购资金孳生利息人民币 26,885.23 元为网上现金认购产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)。为更好地实现投资目标，基金还可投资于包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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、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、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)。在符合法律法规规定的情况下，本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金的业绩比较基准为：中证国有企业红利指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

（2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

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

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	145,264.14
等于：本金	145,205.16
加：应计利息	58.98
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	145,264.14

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		26,311,692.19	-	23,668,918.80	-2,642,773.39
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		26,311,692.19	-	23,668,918.80	-2,642,773.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	25,700.09
合计	25,700.09

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,836,000.00	59,836,000.00
本期申购	3,500,000.00	3,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-38,000,000.00	-38,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	25,336,000.00	25,336,000.00

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,716,841.44	-4,648,648.95	1,068,192.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,716,841.44	-4,648,648.95	1,068,192.49
本期利润	3,118,799.38	-3,675,097.60	-556,298.22
本期基金份额交易产生的变动数	-4,124,732.84	2,262,478.73	-1,862,254.11
其中：基金申购款	525,387.44	-319,439.64	205,947.80
基金赎回款	-4,650,120.28	2,581,918.37	-2,068,201.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,710,907.98	-6,061,267.82	-1,350,359.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,582.87
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	45.94
合计	1,628.81

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,180,469.74
股票投资收益——赎回差价收入	1,516,162.34
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	2,696,632.08

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	18,992,230.00
减：卖出股票成本总额	17,793,603.45
减：交易费用	18,156.81
买卖股票差价收入	1,180,469.74

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	40,068,201.91
减：现金支付赎回款总额	6,126,892.91
减：赎回股票成本总额	32,425,146.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,516,162.34

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	534,108.24
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	534,108.24

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-3,675,097.60
——股票投资	-3,675,097.60
——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	-3,675,097.60

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
ETF 基金替代损益	13,816.81
合计	13,816.81

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	3,229.71
信息披露费	22,470.38
证券出借违约金	-
合计	25,700.09

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
广发证券股份有限公司	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 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。

6.4.10.1.5 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	83,198.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,130.94
应支付基金管理人的净管理费	56,067.06

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 0.45% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.45% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,488.47

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	1,203,100.00	4.75%	1,651,000.00	2.76%

其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	145,264.14	1,582.87

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，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

本基金本报告期期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	28,600	258,764.13	258,830.00	-

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人广发证券股份有限公司为本基金开立的银行存款账户，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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	145,264.14	-	-	-	145,264.14
存出保证金	209,132.58	-	-	-	209,132.58
交易性金融 资产	-	-	-	23,668,918.8 0	23,668,918.8 0
资产总计	354,396.72	-	-	23,668,918.8 0	24,023,315.5 2
负债					
应付管理人 报酬	-	-	-	9,797.95	9,797.95
应付托管费	-	-	-	2,177.32	2,177.32
其他负债	-	-	-	25,700.09	25,700.09
负债总计	-	-	-	37,675.36	37,675.36
利率敏感度 缺口	354,396.72	-	-	23,631,243.4 4	23,985,640.1 6
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	328,015.60	-	-	-	328,015.60
存出保证金	299,807.23	-	-	-	299,807.23
交易性金融 资产	-	-	-	60,373,087.8 3	60,373,087.8 3
资产总计	627,822.83	-	-	60,373,087.8 3	61,000,910.6 6
负债					
应付清算款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	26,541.40	26,541.40
应付托管费	-	-	-	5,898.10	5,898.10
其他负债	-	-	-	64,278.67	64,278.67
负债总计	-	-	-	96,718.17	96,718.17
利率敏感度缺口	627,822.83	-	-	60,276,369.66	60,904,192.49

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

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	23,668,918.80	98.68	60,373,087.83	99.13

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	23,668,918.80	98.68	60,373,087.83	99.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	1,159,185.30	2,930,509.68
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,159,185.30	-2,930,509.68

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	23,410,088.80
第二层次	258,830.00
第三层次	-
合计	23,668,918.80

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整

中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 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	23,668,918.80	98.52
	其中：股票	23,668,918.80	98.52
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	145,264.14	0.60
7	其他各项资产	209,132.58	0.87
8	合计	24,023,315.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元			
代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	4,448,035.25	18.54
C	制造业	3,073,737.00	12.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	771,544.00	3.22
E	建筑业	1,174,595.00	4.90
F	批发和零售业	991,740.00	4.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2,441,746.00	10.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	380,094.00	1.58
J	金融业	8,001,842.10	33.36
K	房地产业	222,456.00	0.93
L	租赁和商务服务业	928,256.00	3.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,232,659.00	5.14
S	综合	-	-
	合计	23,666,704.35	98.67

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,214.45	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,214.45	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601919	中远海控	35,700	473,382.00	1.97
2	600755	厦门国贸	63,800	345,796.00	1.44
3	601699	潞安环能	23,600	337,008.00	1.41
4	600153	建发股份	41,600	329,888.00	1.38
5	600971	恒源煤电	47,800	329,820.00	1.38
6	000983	山西焦煤	54,800	317,840.00	1.33
7	601229	上海银行	35,700	309,876.00	1.29
8	601166	兴业银行	18,500	306,360.00	1.28
9	600919	江苏银行	27,800	299,684.00	1.25
10	601666	平煤股份	41,400	296,010.00	1.23
11	603167	渤海轮渡	34,000	291,380.00	1.21
12	601077	渝农商行	47,100	287,781.00	1.20
13	600546	山煤国际	26,000	284,180.00	1.18
14	600015	华夏银行	44,400	283,716.00	1.18
15	601818	光大银行	97,800	282,642.00	1.18
16	600039	四川路桥	35,900	280,738.00	1.17
17	600894	广日股份	36,200	275,844.00	1.15
18	601328	交通银行	42,600	273,918.00	1.14
19	601009	南京银行	27,600	272,964.00	1.14
20	601187	厦门银行	39,800	271,834.00	1.13
21	601658	邮储银行	54,900	270,657.00	1.13
22	600188	兖矿能源	15,025	266,994.25	1.11
23	601225	陕西煤业	13,100	266,585.00	1.11
24	601169	北京银行	54,100	265,090.00	1.11
25	600282	南钢股份	57,700	264,843.00	1.10
26	600985	淮北矿业	18,800	264,140.00	1.10
27	601998	中信银行	37,500	259,875.00	1.08

28	601369	陕鼓动力	28,600	258,830.00	1.08
29	601398	工商银行	36,600	258,762.00	1.08
30	601939	建设银行	26,800	258,084.00	1.08
31	601168	西部矿业	9,500	257,830.00	1.07
32	601825	沪农商行	34,400	257,656.00	1.07
33	601088	中国神华	6,500	253,760.00	1.06
34	600057	厦门象屿	46,600	252,572.00	1.05
35	600036	招商银行	7,100	252,050.00	1.05
36	601006	大秦铁路	54,300	250,323.00	1.04
37	601838	成都银行	14,100	249,570.00	1.04
38	601988	中国银行	43,600	249,392.00	1.04
39	600096	云天化	8,200	249,280.00	1.04
40	601288	农业银行	40,700	247,049.00	1.03
41	600348	华阳股份	32,100	245,565.00	1.02
42	600737	中粮糖业	19,900	245,367.00	1.02
43	600820	隧道股份	46,000	239,660.00	1.00
44	600901	江苏金租	41,600	239,200.00	1.00
45	002807	江阴银行	63,510	235,622.10	0.98
46	002839	张家港行	60,200	234,780.00	0.98
47	002966	苏州银行	33,700	234,552.00	0.98
48	601916	浙商银行	88,000	231,440.00	0.96
49	600997	开滦股份	48,000	228,000.00	0.95
50	601928	凤凰传媒	25,800	226,782.00	0.95
51	601665	齐鲁银行	39,300	226,761.00	0.95
52	600123	兰花科创	42,400	226,416.00	0.94
53	600502	安徽建工	52,020	226,287.00	0.94
54	601577	长沙银行	25,900	225,589.00	0.94
55	601997	贵阳银行	43,600	223,668.00	0.93
56	600064	南京高科	31,200	222,456.00	0.93
57	601000	唐山港	53,400	221,610.00	0.92
58	001227	兰州银行	110,300	220,600.00	0.92
59	600373	中文传媒	32,700	216,801.00	0.90
60	000090	天健集团	71,800	216,118.00	0.90
61	603128	华贸物流	42,600	215,130.00	0.90
62	600028	中国石化	48,200	214,972.00	0.90
63	600350	山东高速	19,200	213,696.00	0.89
64	002304	洋河股份	5,600	213,640.00	0.89
65	000429	粤高速 A	15,600	212,940.00	0.89
66	000157	中联重科	30,400	211,888.00	0.88
67	601668	中国建筑	48,800	211,792.00	0.88
68	600461	洪城环境	23,200	210,192.00	0.88
69	000708	中信特钢	16,500	208,230.00	0.87
70	300770	新媒股份	6,600	207,834.00	0.87

71	002091	江苏国泰	28,600	206,778.00	0.86
72	600008	首创环保	75,700	205,904.00	0.86
73	600704	物产中大	43,300	204,376.00	0.85
74	601921	浙版传媒	30,400	203,376.00	0.85
75	600926	杭州银行	14,000	202,300.00	0.84
76	600741	华域汽车	13,000	201,760.00	0.84
77	601098	中南传媒	20,500	201,720.00	0.84
78	605599	菜百股份	14,700	201,390.00	0.84
79	600729	重百集团	10,600	199,068.00	0.83
80	601001	晋控煤业	11,400	198,246.00	0.83
81	601598	中国外运	39,900	197,904.00	0.83
82	002267	陕天然气	29,700	194,238.00	0.81
83	601019	山东出版	30,300	193,920.00	0.81
84	600585	海螺水泥	11,400	193,230.00	0.81
85	601860	紫金银行	79,700	192,874.00	0.80
86	601101	昊华能源	18,200	192,192.00	0.80
87	600908	无锡银行	37,800	192,024.00	0.80
88	600012	皖通高速	12,100	190,696.00	0.80
89	600757	长江传媒	26,000	190,060.00	0.79
90	601857	中国石油	21,700	188,356.00	0.79
91	601963	重庆银行	18,400	185,472.00	0.77
92	002697	红旗连锁	43,300	180,128.00	0.75
93	600582	天地科技	39,700	176,665.00	0.74
94	000933	神火股份	8,300	175,960.00	0.73
95	601298	青岛港	21,700	174,685.00	0.73
96	600941	中国移动	2,000	172,260.00	0.72
97	000858	五粮液	2,300	170,200.00	0.71
98	600938	中国海油	6,100	165,615.00	0.69
99	600863	华能蒙电	34,300	161,210.00	0.67
100	601898	中煤能源	11,700	142,506.00	0.59

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603248	锡华科技	105	2,214.45	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例(%)
1	600188	兖矿能源	331,238.00	0.54
2	000933	神火股份	300,258.00	0.49
3	002304	洋河股份	281,188.00	0.46
4	600096	云天化	272,485.00	0.45
5	605599	菜百股份	255,597.00	0.42
6	601088	中国神华	253,158.00	0.42
7	601699	潞安环能	244,004.00	0.40
8	001227	兰州银行	242,179.00	0.40
9	600926	杭州银行	233,714.00	0.38
10	601001	晋控煤业	226,816.00	0.37
11	300770	新媒股份	226,201.00	0.37
12	000983	山西焦煤	224,502.00	0.37
13	600938	中国海油	223,058.00	0.37
14	601860	紫金银行	212,757.00	0.35
15	600908	无锡银行	211,286.00	0.35
16	600704	物产中大	206,752.00	0.34
17	600755	厦门国贸	201,162.00	0.33
18	601298	青岛港	198,152.00	0.33
19	601963	重庆银行	197,233.00	0.32
20	600057	厦门象屿	192,095.00	0.32

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000983	山西焦煤	771,185.00	1.27
2	000933	神火股份	679,914.00	1.12
3	000906	浙商中拓	607,622.00	1.00
4	600188	兖矿能源	574,890.00	0.94
5	000719	中原传媒	567,850.00	0.93
6	001965	招商公路	549,966.00	0.90
7	000928	中钢国际	541,580.00	0.89
8	002267	陕天然气	527,283.00	0.87
9	000429	粤高速 A	447,602.00	0.73
10	601699	潞安环能	436,050.00	0.72
11	002304	洋河股份	426,818.00	0.70
12	000157	中联重科	424,866.00	0.70
13	601919	中远海控	414,837.00	0.68
14	002966	苏州银行	414,174.00	0.68
15	002697	红旗连锁	381,669.00	0.63
16	000090	天健集团	381,394.00	0.63

17	601168	西部矿业	372,238.00	0.61
18	002091	江苏国泰	363,172.00	0.60
19	002807	江阴银行	356,168.00	0.58
20	002839	张家港行	351,907.00	0.58

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	14,295,751.68
卖出股票收入（成交）总额	18,992,230.00

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 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，平顶山天安煤业股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到平顶山市应急管理局、国家矿山安全监察局河南局、国家矿山安全监察局陕西局处罚的情况；上海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上海监管局、中国人民银行处罚的情况；兴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。

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。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	209,132.58
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	209,132.58

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 报告期末股票投资中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
586	43,235.49	3,926,900.00	15.50 %	21,409,100.00	84.50 %

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 9 月 24 日)基金份额总额	444,836,000.00
本报告期期初基金份额总额	59,836,000.00
本报告期基金总申购份额	3,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	38,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,336,000.00

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人高级管理人员和相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
国投证券	7	33,287,981.68	100.00%	6,522.52	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、本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-26
3	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
4	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-20
5	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金（2026 年 6 月）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
6	创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、《创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金 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