

创金合信中证 1000 指数增强型发起式 证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2024 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 2024 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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证 1000 增强	
基金主代码	003646	
交易代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,399,665.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份额总额	24,954,187.10 份	27,445,478.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人		基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司		中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田	任航
	联系电话	0755-82820166	010-66060069
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-868-0666	95599
传真	0755-25832571	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518052	100031
法定代表人	钱龙海	谷澍

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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信中证 1000 增强 A

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	2,855,828.23	87,249.20	-7,907,153.50
本期利润	2,546,377.54	1,114,897.44	-9,091,568.08
加权平均基金份额本期利润	0.1017	0.0417	-0.3462
本期加权平均净值利润率	7.54%	2.69%	-22.26%
本期基金份额净值增长率	5.51%	-1.30%	-16.25%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	9,636,885.13	7,434,109.89	11,346,726.35
期末可供分配基金份额利润	0.3862	0.2929	0.3261
期末基金资产净值	38,482,388.67	37,092,851.07	51,521,946.88
期末基金份额净值	1.5421	1.4615	1.4807
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	54.21%	46.15%	48.07%

2、创金合信中证 1000 增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	3,061,653.31	-903,044.13	-13,533,381.55
本期利润	2,852,452.75	-491,868.18	-19,457,066.41
加权平均基金份额本期利润	0.0966	-0.0167	-0.3647
本期加权平均净值利润率	7.30%	-1.09%	-23.68%
本期基金份额净值增长率	5.30%	-1.49%	-16.43%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	9,867,729.91	7,780,264.87	9,195,915.97
期末可供分配基金份额利润	0.3595	0.2708	0.3065
期末基金资产净值	41,582,293.86	41,331,949.28	43,829,729.92
期末基金份额净值	1.5151	1.4388	1.4606
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	51.51%	43.88%	46.06%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

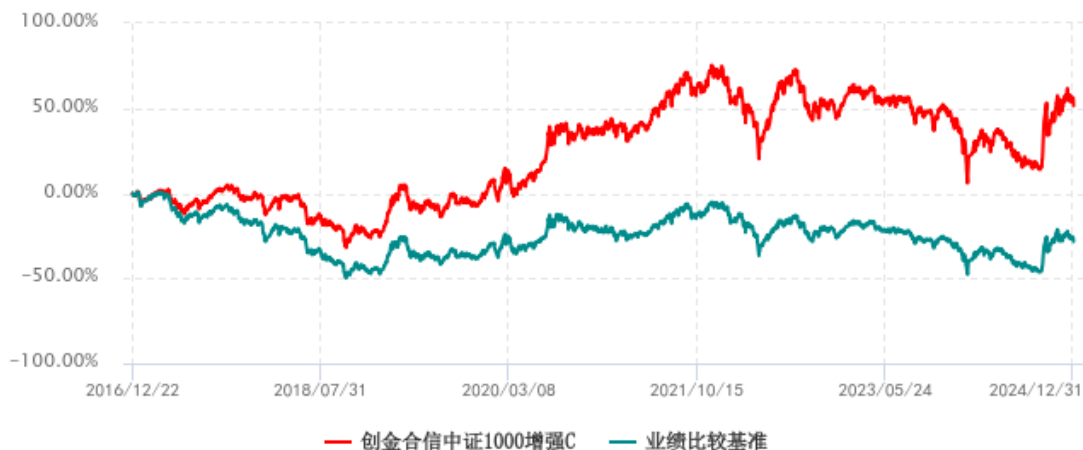
创金合信中证 1000 增强 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	6.99%	2.25%	4.24%	2.28%	2.75%	-0.03%
过去六个月	22.36%	2.04%	20.72%	2.13%	1.64%	-0.09%
过去一年	5.51%	1.97%	1.47%	2.01%	4.04%	-0.04%
过去三年	-12.78%	1.54%	-24.00%	1.54%	11.22%	0.00%
过去五年	51.62%	1.48%	7.83%	1.49%	43.79%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	54.21%	1.41%	-28.32%	1.43%	82.53%	-0.02%

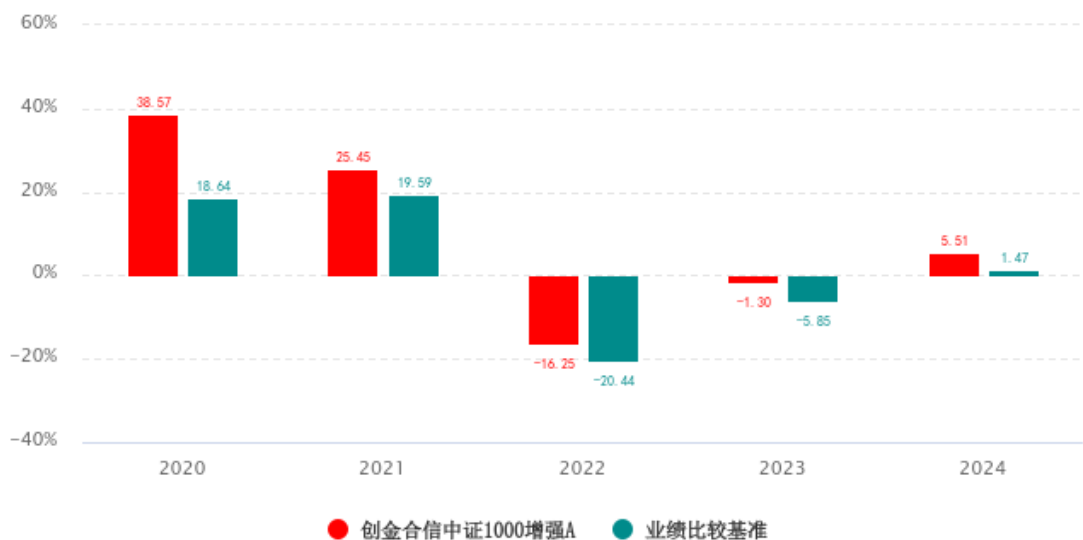
创金合信中证 1000 增强 C

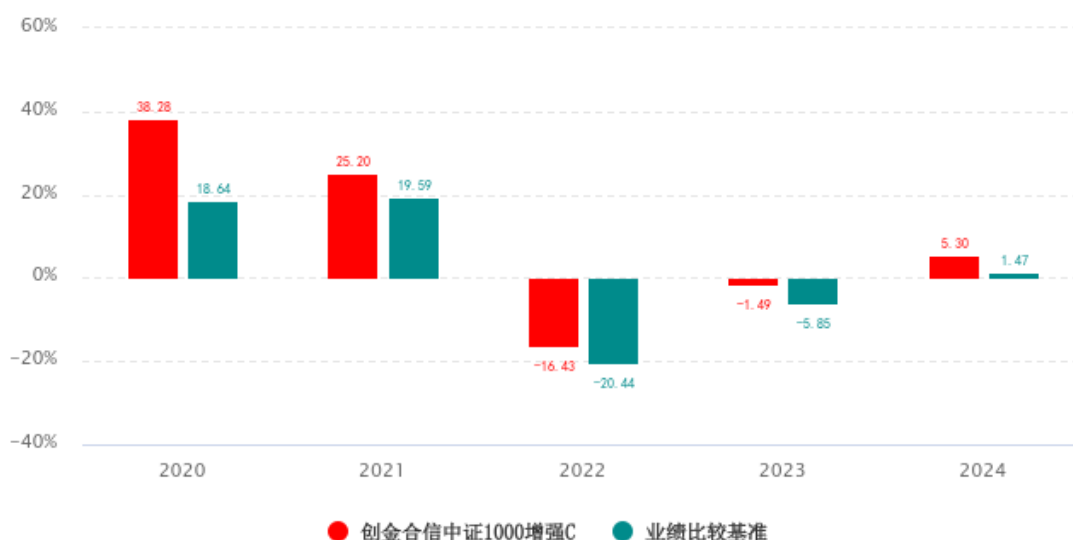
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	6.93%	2.25%	4.24%	2.28%	2.69%	-0.03%
过去六个月	22.23%	2.04%	20.72%	2.13%	1.51%	-0.09%
过去一年	5.30%	1.97%	1.47%	2.01%	3.83%	-0.04%
过去三年	-13.31%	1.54%	-24.00%	1.54%	10.69%	0.00%
过去五年	50.08%	1.48%	7.83%	1.49%	42.25%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	51.51%	1.40%	-28.32%	1.43%	79.83%	-0.03%

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1000增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月22日-2024年12月31日)创金合信中证1000增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月22日-2024年12月31日)

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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

创金合信基金始终坚持“客户利益至上”，做客户投资理财的亲密伙伴。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙悦	本基金基金经理	2021 年 7 月 9 日	-	7	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

	理				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。
董梁	本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人	2019 年 7 月 5 日	-	21	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003 年 12 月加入 UNX Inc 任分析师，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015 年 1 月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数部负责人、基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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交易指令时，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交易指令。

4、公平交易监控

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，美国大选尘埃落定，特朗普重新当选总统，于 2025 年 1 月份正式上任，对未来四年的全球政治局势、经济环境的走势产生重要影响。美联储方面，9 月降息 50bp 开启了降息进程，鲍威尔在 12 月议息会议表示，25 年仍有一定降息空间，但降息步伐或将放缓。国内宏观环境相对平稳，9 月底政策发生明显变化，中央经济工作会议于 12 月召开，强调要实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，保持经济稳定增长。大类资产方面，原油价格持平，黄金价格、美元指数、美股指数上涨。国内市场行情方面，9 月底主要指数明显上涨后，风格、行业表现分化，小盘、科技板块表现亮眼，12 月中下旬，市场风格再次转变，小盘、科技回调，红利策略表现较好。

本基金以中证 1000 指数为基准，2024 年，中证 1000 指数小幅上涨，指数成分股内，行业表现分化较大，相对表现最好的行业是银行、汽车、交通运输，表现最差的是纺织服装、农林牧渔、医药生物。风格方面，成分股内 beta 因子表现较好，成长因子表现较差。

在产品管理过程中，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资。采用经典的多因子模型对个股进行收益预测，采用风险模型严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制投资组合相对基准指数的跟踪误差，在此基础上追求高胜率、可持续的超额收益。在投资过程中，持续对多因子模型进行改进，加入新因子、采用新算法、不断提高模型的预测能力，同时叠加行业轮动策略、短周期交易策略，力争增厚投资组合收益。最后，由于中证 1000 指数部分成分股市值偏小，投资风险相对更高，在投资过程中利用量化模型对中小市值股票进行监控，规避基本面出现严重恶化或者发生重大负面事件的股票。

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 1000 增强 A 基金份额净值为 1.5421 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.51%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；截至本报告期末创金合信中证 1000 增强 C 基金份额净值为 1.5151 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%。

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 2025 年，特朗普的政策可能会是最大的不确定性来源，国内宏观经济与证券市场仍然会承受波动，政策层的应对措施同样将产生重要影响。美联储方面，预计延续降息趋

势，但可能节奏放缓，美元可能保持强势。国内方面，2024 年 9 月底以来政策发生明显转向，12 月中央经济工作会议做出重要部署，预计 2025 年财政政策和货币政策有更大的发力空间，对经济形成重要支撑，带动消费、地产投资回暖。

国内证券市场方面，2024 年 9 月底市场反转后，由于经济呈弱复苏局面，而市场流动性明显复苏，叠加 AI 领域出现重要进步，市场风格偏好小盘、科技板块。展望后市，随着经济进一步复苏，预计与宏观经济相关性更强的板块有进一步估值修复的空间。红利风格 2024 年以来相对表现较好，大部分公司基本面依旧稳健，仍然有较高的长期投资价值。

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；完善信息披露工作，优化信息披露流程及各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作。

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，定期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，公司定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，警示公司管理及业务运作中存在的风险，提出整改意见并监督落实。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—创金合信基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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	安永华明（2025）审字第 70072441_H11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 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，后附的创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师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，我们独立于创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金，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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则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。 在编制财务报表时，管理层负责评估创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （3）评价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。 （4）对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，就可能导致对创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资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创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金不能持续经营。 （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。 我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高鹤	林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,854,519.72	2,082,757.02
结算备付金		1,780,241.00	1,390,662.51
存出保证金		311,150.67	171,156.50
交易性金融资产	7.4.7.2	74,328,836.55	75,618,490.05
其中：股票投资		72,698,258.58	72,741,299.74
基金投资		-	-
债券投资		1,630,577.97	2,877,190.31
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		553,302.34	349,494.64
应收股利		-	-
应收申购款		93,629.66	94,374.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		80,921,679.94	79,706,934.93
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		-	500,451.56
应付清算款		481,478.91	386,395.15

应付赎回款		154,419.65	33,383.38
应付管理人报酬		56,769.27	53,737.35
应付托管费		10,644.27	10,075.75
应付销售服务费		7,273.97	7,042.94
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	146,411.34	291,048.45
负债合计		856,997.41	1,282,134.58
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	52,399,665.38	54,106,966.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	27,665,017.15	24,317,833.69
净资产合计		80,064,682.53	78,424,800.35
负债和净资产总计		80,921,679.94	79,706,934.93

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，创金合信中证 1000 增强 A 份额净值 1.5421 元，基金份额总额 24,954,187.10 份；创金合信中证 1000 增强 C 份额净值 1.5151 元，基金份额总额 27,445,478.28 份；总份额合计 52,399,665.38 份。

7.2 利润表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,313,650.04	1,723,380.15
1.利息收入		46,063.20	51,888.29
其中：存款利息收入	7.4.7.9	46,063.20	51,888.29
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）		6,563,870.21	117,271.62
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,365,573.95	-996,645.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	37,565.02	84,639.14

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	-27,693.14	4,227.07
股利收益	7.4.7.15	1,188,424.38	1,025,051.06
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	-518,651.25	1,438,824.19
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	222,367.88	115,396.05
减：二、营业总支出		914,819.75	1,100,350.89
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	580,965.25	694,095.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	108,931.00	130,142.96
3.销售服务费	7.4.10.2.3	77,727.03	90,259.99
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		4,132.92	25,783.95
其中：卖出回购金融资产 支出		4,132.92	25,783.95
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		544.73	471.53
8.其他费用	7.4.7.19	142,518.82	159,597.01
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		5,398,830.29	623,029.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		5,398,830.29	623,029.26
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		5,398,830.29	623,029.26

7.3 净资产变动表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	54,106,966.66	-	24,317,833.69	78,424,800.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,106,966.66	-	24,317,833.69	78,424,800.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,707,301.28	-	3,347,183.46	1,639,882.18
（一）、综合收益总额	-	-	5,398,830.29	5,398,830.29
（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）	-1,707,301.28	-	-2,051,646.83	-3,758,948.11
其中：1.基金申购款	56,102,120.25	-	18,169,740.74	74,271,860.99
2.基金赎回款	-57,809,421.53	-	-20,221,387.57	-78,030,809.10
（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	52,399,665.38	-	27,665,017.15	80,064,682.53
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	64,802,087.55	-	30,549,589.25	95,351,676.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	64,802,087.55	-	30,549,589.25	95,351,676.80

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,695,120.89	-	-6,231,755.56	-16,926,876.45
（一）、综合收益总额	-	-	623,029.26	623,029.26
（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）	-10,695,120.89	-	-6,854,784.82	-17,549,905.71
其中：1.基金申购款	33,730,142.56	-	18,482,900.13	52,213,042.69
2.基金赎回款	-44,425,263.45	-	-25,337,684.95	-69,762,948.40
（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	54,106,966.66	-	24,317,833.69	78,424,800.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____ ____奚胜田____ ____吉祥____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1918 号《关于准予创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,115,380.08 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1553 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，

《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,115,717.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 337.34 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。根据《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板、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、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、金融衍生品（包括权证、股指期货等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度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

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，

本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的高低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资

产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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 号文《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 号文《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 号文《财政部、国家税务总局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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）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 号文《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，（如有）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（如适用）

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 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,854,519.72	2,082,757.02
等于：本金	3,853,684.51	2,082,244.38

加：应计利息	835.21	512.64
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	3,854,519.72	2,082,757.02

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		75,761,964.35	-	72,698,258.58	-3,063,705.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,604,298.00	29,297.97	1,630,577.97	-3,018.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,604,298.00	29,297.97	1,630,577.97	-3,018.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		77,366,262.35	29,297.97	74,328,836.55	-3,066,723.77
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		74,642,169.70	-	72,741,299.74	-1,900,869.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,836,236.00	39,516.87	2,877,190.31	1,437.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,836,236.00	39,516.87	2,877,190.31	1,437.44
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	77,478,405.70	39,516.87	75,618,490.05	-1,899,432.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,695,840.00	-	-	-
--股指期货	1,695,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,695,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,161,240.00	-	-	-
--股指期货	1,161,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,161,240.00	-	-	-

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

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2503	IM2503	2.00	2,352,560.00	656,720.00
合计				656,720.00
减：可抵销期货暂收款				656,720.00
净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	33.03	43.98
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	38,378.31	156,004.47
其中：交易所市场	38,378.31	156,004.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	108,000.00	135,000.00
合计	146,411.34	291,048.45

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信中证 1000 增强 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,379,853.85	25,379,853.85
本期申购	11,745,745.75	11,745,745.75
本期赎回（以“-”号填列）	-12,171,412.50	-12,171,412.50
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	24,954,187.10	24,954,187.10

创金合信中证 1000 增强 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,727,112.81	28,727,112.81
本期申购	44,356,374.50	44,356,374.50
本期赎回（以“-”号填列）	-45,638,009.03	-45,638,009.03
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	27,445,478.28	27,445,478.28

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

创金合信中证 1000 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,434,109.89	4,278,887.33	11,712,997.22

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,434,109.89	4,278,887.33	11,712,997.22
本期利润	2,855,828.23	-309,450.69	2,546,377.54
本期基金份额交易产生的变动数	-653,052.99	-78,120.20	-731,173.19
其中：基金申购款	1,479,437.57	2,586,724.71	4,066,162.28
基金赎回款	-2,132,490.56	-2,664,844.91	-4,797,335.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,636,885.13	3,891,316.44	13,528,201.57

创金合信中证 1000 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,780,264.87	4,824,571.60	12,604,836.47
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,780,264.87	4,824,571.60	12,604,836.47
本期利润	3,061,653.31	-209,200.56	2,852,452.75
本期基金份额交易产生的变动数	-974,188.27	-346,285.37	-1,320,473.64
其中：基金申购款	5,587,849.05	8,515,729.41	14,103,578.46
基金赎回款	-6,562,037.32	-8,862,014.78	-15,424,052.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,867,729.91	4,269,085.67	14,136,815.58

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,865.18	19,726.58
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	22,603.49	31,584.88
其他	594.53	576.83
合计	46,063.20	51,888.29

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

股票投资收益——买卖股票差价收入	5,365,573.95	-996,645.65
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	5,365,573.95	-996,645.65

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	555,791,817.34	912,024,109.32
减：卖出股票成本总额	549,778,210.42	911,322,839.11
减：交易费用	648,032.97	1,697,915.86
买卖股票差价收入	5,365,573.95	-996,645.65

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	35,949.55	48,490.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,615.47	36,148.36
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	37,565.02	84,639.14

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,517,539.64	4,730,773.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,436,346.00	4,614,056.00
减：应计利息总额	79,576.66	80,563.12
减：交易费用	1.51	6.46
买卖债券差价收入	1,615.47	36,148.36

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
期货投资	-27,693.14	4,227.07

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,188,424.38	1,025,051.06
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	1,188,424.38	1,025,051.06

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,167,291.25	1,465,384.19
——股票投资	-1,162,835.81	1,463,068.75
——债券投资	-4,455.44	2,315.44
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	648,640.00	-26,560.00
——权证投资	-	-

——期货投资	648,640.00	-26,560.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-518,651.25	1,438,824.19

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	219,012.97	114,432.46
转换费收入	3,354.91	963.59
合计	222,367.88	115,396.05

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	18,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	3,815.86	4,597.01
账户维护费	702.96	-
指数使用费	40,000.00	40,000.00
合计	142,518.82	159,597.01

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	485,577,206.19	43.88%	1,805,645,162.20	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	4,438,314.96	58.08%	10,343,202.45	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	7,600,000.00	100.00%	55,101,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	214,057.67	71.58%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	775,934.09	100.00%	156,004.47	100.00%

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	580,965.25	694,095.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	246,555.69	283,907.32
应支付基金管理人的净管理费	334,409.56	410,188.13

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 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	108,931.00	130,142.96

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	154.23	154.23
第一创业证券	-	334.95	334.95
合计	-	489.18	489.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	114.31	114.31
第一创业证券	-	155.15	155.15
合计	-	269.46	269.46

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 0.2% 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 × 0.2% / 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国农业银行股份有限公司	3,854,519.72	22,865.18	2,082,757.02	19,726.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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（2024 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

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,630,577.97	2,839,752.33
合计	1,630,577.97	2,839,752.33

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	37,437.98
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	37,437.98

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

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 2024 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公司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 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	3,854,519.72	-	-	-	3,854,519.72
结算备付金	1,780,241.00	-	-	-	1,780,241.00
存出保证金	311,150.67	-	-	-	311,150.67
交易性金融资产	1,630,577.97	-	-	72,698,258.58	74,328,836.55
应收申购款	-	-	-	93,629.66	93,629.66
应收清算款	-	-	-	553,302.34	553,302.34
资产总计	7,576,489.36	-	-	73,345,190.58	80,921,679.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	154,419.65	154,419.65
应付管理人报酬	-	-	-	56,769.27	56,769.27
应付托管费	-	-	-	10,644.27	10,644.27
应付销售服务费	-	-	-	7,273.97	7,273.97
应付清算款	-	-	-	481,478.91	481,478.91
其他负债	-	-	-	146,411.34	146,411.34
负债总计	-	-	-	856,997.41	856,997.41
利率敏感度缺口	7,576,489.36	-	-	72,488,193.17	80,064,682.53
上年度末 2023 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	2,082,757.02	-	-	-	2,082,757.02
结算备付金	1,390,662.51	-	-	-	1,390,662.51
存出保证金	171,156.50	-	-	-	171,156.50
交易性金融资产	2,839,752.33	-	37,437.98	72,741,299.74	75,618,490.05
应收申购款	-	-	-	94,374.21	94,374.21

应收清算款	-	-	-	349,494.64	349,494.64
资产总计	6,484,328.36	-	37,437.98	73,185,168.59	79,706,934.93
负债					
卖出回购金融资产款	500,451.56	-	-	-	500,451.56
应付赎回款	-	-	-	33,383.38	33,383.38
应付管理人报酬	-	-	-	53,737.35	53,737.35
应付托管费	-	-	-	10,075.75	10,075.75
应付销售服务费	-	-	-	7,042.94	7,042.94
应付清算款	-	-	-	386,395.15	386,395.15
其他负债	-	-	-	291,048.45	291,048.45
负债总计	500,451.56	-	-	781,683.02	1,282,134.58
利率敏感度缺口	5,983,876.80	-	37,437.98	72,403,485.57	78,424,800.35

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2024 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2023 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-277.01	-2,229.45
	2.市场利率平行下降 25 个基点	277.38	2,233.07

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	72,698,258.58	90.80	72,741,299.74	92.75
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	72,698,258.58	90.80	72,741,299.74	92.75

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	3,450,622.84	3,714,170.76
	2.业绩比较基准下降 5%	-3,450,622.84	-3,714,170.76

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。

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	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
--------------	----------------------	-----------------------

次		
第一层次	72,698,258.58	72,709,361.84
第二层次	1,630,577.97	2,909,128.21
第三层次	-	-
合计	74,328,836.55	75,618,490.05

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
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	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	140,564.90	140,564.90
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	161,037.60	161,037.60
当期利得或损失总额	-	20,472.70	20,472.70
其中：计入损益的利得或损失	-	20,472.70	20,472.70
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	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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资产（2023 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应收款项和其他金融负债，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 2024 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	72,698,258.58	89.84
	其中：股票	72,698,258.58	89.84
2	固定收益投资	1,630,577.97	2.02
	其中：债券	1,630,577.97	2.02
	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	5,634,760.72	6.96
7	其他各项资产	958,082.67	1.18
8	合计	80,921,679.94	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	49,159.00	0.06
C	制造业	47,744,217.63	59.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	599,377.00	0.75
F	批发和零售业	1,540,193.00	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,002,343.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,912,230.12	9.88
J	金融业	1,043,445.00	1.30
K	房地产业	357,186.00	0.45
L	租赁和商务服务业	1,300,024.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	2,701,954.03	3.37
N	水利、环境和公共设施管理业	152,269.00	0.19
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	310,358.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	64,712,755.78	80.83

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,452,375.68	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,370.00	0.12
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	504,445.00	0.63
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	1,425,591.62	1.78
J	金融业	449,982.00	0.56
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	56,738.50	0.07
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	7,985,502.80	9.97

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688408	中信博	14,173	1,020,456.00	1.27
2	300088	长信科技	155,300	1,015,662.00	1.27
3	601222	林洋能源	141,800	1,002,526.00	1.25
4	000951	中国重汽	58,700	996,726.00	1.24
5	600216	浙江医药	62,500	991,250.00	1.24
6	300674	宇信科技	50,200	979,904.00	1.22
7	002745	木林森	110,600	964,432.00	1.20
8	601369	陕鼓动力	109,500	952,650.00	1.19
9	601311	骆驼股份	113,643	942,100.47	1.18
10	000528	柳工	77,600	935,856.00	1.17
11	002906	华阳集团	30,200	928,650.00	1.16
12	301031	中熔电气	8,900	925,778.00	1.16
13	688131	皓元医药	25,832	922,202.40	1.15
14	002550	千红制药	148,500	920,700.00	1.15
15	603609	禾丰股份	106,600	918,892.00	1.15

16	300035	中科电气	61,400	917,930.00	1.15
17	002987	京北方	63,964	910,207.72	1.14
18	688526	科前生物	62,848	898,097.92	1.12
19	002967	广电计量	54,700	897,080.00	1.12
20	688403	汇成股份	98,426	881,896.96	1.10
21	002446	盛路通信	134,500	880,975.00	1.10
22	688352	硕中科技	72,436	878,648.68	1.10
23	002773	康弘药业	43,700	856,520.00	1.07
24	002212	天融信	131,500	848,175.00	1.06
25	300327	中颖电子	34,300	839,321.00	1.05
26	002534	西子洁能	75,300	836,583.00	1.04
27	600531	豫光金铅	130,100	835,242.00	1.04
28	600428	中远海特	113,800	830,740.00	1.04
29	002174	游族网络	84,500	790,075.00	0.99
30	603267	鸿远电子	21,800	789,814.00	0.99
31	300083	创世纪	113,200	736,932.00	0.92
32	301015	百洋医药	29,800	721,458.00	0.90
33	002036	联创电子	76,400	718,160.00	0.90
34	600420	国药现代	60,100	717,594.00	0.90
35	300034	钢研高纳	45,300	706,680.00	0.88
36	300181	佐力药业	44,300	680,448.00	0.85
37	002498	汉缆股份	199,600	676,644.00	0.85
38	603612	索通发展	49,100	663,341.00	0.83
39	000680	山推股份	67,200	651,840.00	0.81
40	002043	兔宝宝	53,200	632,016.00	0.79
41	002145	中核钛白	148,200	628,368.00	0.78
42	600409	三友化工	108,500	585,900.00	0.73
43	605333	沪光股份	17,700	577,551.00	0.72
44	300773	拉卡拉	31,800	562,860.00	0.70
45	002226	江南化工	100,900	546,878.00	0.68
46	600643	爱建集团	105,400	544,918.00	0.68
47	603383	顶点软件	14,300	536,250.00	0.67
48	605123	派克新材	9,700	521,472.00	0.65
49	605111	新洁能	15,300	518,823.00	0.65
50	300705	九典制药	28,700	515,165.00	0.64
51	000049	德赛电池	21,500	505,465.00	0.63
52	300821	东岳硅材	64,000	496,640.00	0.62
53	300257	开山股份	53,700	489,744.00	0.61
54	002233	塔牌集团	63,800	489,346.00	0.61
55	600662	外服控股	95,000	481,650.00	0.60
56	600587	新华医疗	28,600	476,190.00	0.59
57	688209	英集芯	26,277	464,314.59	0.58
58	300768	迪普科技	25,700	449,750.00	0.56

59	688372	伟测科技	7,450	435,974.00	0.54
60	300415	伊之密	21,200	425,272.00	0.53
61	000676	智度股份	49,200	416,232.00	0.52
62	600850	电科数字	17,400	415,860.00	0.52
63	301087	可孚医疗	11,600	410,176.00	0.51
64	688007	光峰科技	27,700	409,683.00	0.51
65	002705	新宝股份	26,800	402,000.00	0.50
66	603989	艾华集团	26,300	396,604.00	0.50
67	603328	依顿电子	39,500	389,470.00	0.49
68	603699	纽威股份	17,100	379,107.00	0.47
69	002023	海特高新	37,300	378,595.00	0.47
70	688232	新点软件	12,600	365,274.00	0.46
71	688337	普源精电	9,008	351,312.00	0.44
72	002597	金禾实业	14,800	337,884.00	0.42
73	000686	东北证券	42,400	336,656.00	0.42
74	603678	火炬电子	10,500	320,250.00	0.40
75	601869	长飞光纤	10,700	319,823.00	0.40
76	601886	江河集团	58,300	314,820.00	0.39
77	688798	艾为电子	4,415	308,255.30	0.39
78	301078	孩子王	26,700	303,846.00	0.38
79	300627	华测导航	7,200	300,960.00	0.38
80	688409	富创精密	5,736	295,805.52	0.37
81	688063	派能科技	7,256	290,602.80	0.36
82	301511	德福科技	23,000	288,880.00	0.36
83	603888	新华网	12,800	285,952.00	0.36
84	000821	京山轻机	22,200	276,390.00	0.35
85	002585	双星新材	51,100	272,874.00	0.34
86	605376	博迁新材	9,400	272,130.00	0.34
87	301039	中集车辆	29,900	270,595.00	0.34
88	300451	创业慧康	60,400	270,592.00	0.34
89	688105	诺唯赞	12,139	269,121.63	0.34
90	605589	圣泉集团	11,300	266,454.00	0.33
91	300618	寒锐钴业	7,300	246,521.00	0.31
92	300039	上海凯宝	39,700	245,346.00	0.31
93	000682	东方电子	22,900	245,259.00	0.31
94	002396	星网锐捷	12,900	244,971.00	0.31
95	603013	亚普股份	16,300	244,174.00	0.30
96	600710	苏美达	24,900	231,570.00	0.29
97	002204	大连重工	46,300	230,574.00	0.29
98	600861	北京人力	11,800	228,330.00	0.29
99	002020	京新药业	17,600	225,280.00	0.28
100	603299	苏盐井神	20,200	225,028.00	0.28
101	688066	航天宏图	10,981	224,012.40	0.28

102	300366	创意信息	23,900	222,270.00	0.28
103	300031	宝通科技	11,900	218,008.00	0.27
104	002635	安洁科技	13,500	214,920.00	0.27
105	600478	科力远	51,700	213,521.00	0.27
106	001914	招商积余	19,800	209,286.00	0.26
107	300623	捷捷微电	6,100	208,376.00	0.26
108	000881	中广核技	27,300	200,109.00	0.25
109	600894	广日股份	13,500	197,100.00	0.25
110	000550	江铃汽车	8,000	187,600.00	0.23
111	000065	北方国际	18,500	180,930.00	0.23
112	300416	苏试试验	15,100	177,576.00	0.22
113	300226	上海钢联	7,600	173,812.00	0.22
114	600552	凯盛科技	14,500	165,445.00	0.21
115	300393	中来股份	26,400	165,000.00	0.21
116	002928	华夏航空	21,200	164,512.00	0.21
117	000567	海德股份	23,700	161,871.00	0.20
118	000928	中钢国际	24,900	158,613.00	0.20
119	000970	中科三环	15,200	157,624.00	0.20
120	603337	杰克股份	5,100	155,346.00	0.19
121	600475	华光环能	16,900	152,269.00	0.19
122	688383	新益昌	3,298	147,981.26	0.18
123	600266	城建发展	29,000	147,900.00	0.18
124	002544	普天科技	6,900	147,867.00	0.18
125	300027	华谊兄弟	53,600	140,432.00	0.18
126	002088	鲁阳节能	10,800	138,132.00	0.17
127	002139	拓邦股份	9,900	134,739.00	0.17
128	300079	数码视讯	24,200	130,922.00	0.16
129	600037	歌华有线	17,200	128,312.00	0.16
130	688630	芯碁微装	2,196	126,753.12	0.16
131	600667	太极实业	18,200	125,944.00	0.16
132	002237	恒邦股份	12,100	122,210.00	0.15
133	688432	有研硅	10,721	121,147.30	0.15
134	603317	天味食品	9,000	120,060.00	0.15
135	300726	宏达电子	3,800	118,180.00	0.15
136	000837	秦川机床	13,100	117,507.00	0.15
137	601163	三角轮胎	7,300	110,011.00	0.14
138	002545	东方铁塔	15,400	108,262.00	0.14
139	688336	三生国健	5,042	107,999.64	0.13
140	600757	长江传媒	10,600	101,442.00	0.13
141	000917	电广传媒	13,700	96,859.00	0.12
142	301339	通行宝	4,500	91,530.00	0.11
143	002777	久远银海	4,700	80,934.00	0.10
144	300672	国科微	1,200	80,100.00	0.10

145	688048	长光华芯	1,959	76,381.41	0.10
146	300180	华峰超纤	12,000	75,600.00	0.09
147	000901	航天科技	6,700	73,499.00	0.09
148	600366	宁波韵升	9,700	71,392.00	0.09
149	300457	赢合科技	3,700	70,818.00	0.09
150	300666	江丰电子	900	62,505.00	0.08
151	300475	香农芯创	2,100	59,829.00	0.07
152	002275	桂林三金	3,500	52,815.00	0.07
153	000603	盛达资源	4,100	49,159.00	0.06
154	601801	皖新传媒	6,200	45,508.00	0.06
155	002151	北斗星通	1,700	45,118.00	0.06
156	002626	金达威	2,900	43,790.00	0.05
157	002245	蔚蓝锂芯	4,000	42,760.00	0.05
158	000062	深圳华强	1,900	42,560.00	0.05
159	600320	振华重工	10,800	42,336.00	0.05
160	301262	海看股份	1,700	42,279.00	0.05
161	600572	康恩贝	8,900	41,474.00	0.05
162	688270	臻镭科技	1,168	40,880.00	0.05
163	002461	珠江啤酒	3,900	38,571.00	0.05
164	300685	艾德生物	1,600	36,480.00	0.05
165	688150	莱特光电	1,355	30,514.60	0.04
166	688348	昱能科技	568	27,718.40	0.03
167	601677	明泰铝业	2,300	27,669.00	0.03
168	002249	大洋电机	4,400	25,828.00	0.03
169	601949	中国出版	3,200	22,976.00	0.03
170	300737	科顺股份	4,400	22,308.00	0.03
171	000650	仁和药业	3,800	21,888.00	0.03
172	300772	运达股份	1,500	19,860.00	0.02
173	300080	易成新能	4,100	17,917.00	0.02
174	600882	妙可蓝多	600	10,740.00	0.01
175	688366	昊海生科	172	10,419.76	0.01
176	002468	申通快递	700	7,091.00	0.01
177	002701	奥瑞金	1,100	6,237.00	0.01
178	600961	株冶集团	200	1,574.00	0.00
179	600073	光明肉业	200	1,388.00	0.00
180	000657	中钨高新	90	828.90	0.00
181	688200	华峰测控	6	627.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002284	亚太股份	110,000	851,400.00	1.06
2	002970	锐明技术	17,600	838,288.00	1.05
3	688418	震有科技	27,263	794,989.08	0.99
4	002206	海利得	132,800	569,712.00	0.71
5	600268	国电南自	72,700	488,544.00	0.61
6	000034	神州数码	13,900	487,195.00	0.61
7	002273	水晶光电	21,700	482,174.00	0.60
8	300207	欣旺达	18,600	414,966.00	0.52
9	000636	风华高科	27,300	391,755.00	0.49
10	688508	芯朋微	8,146	350,033.62	0.44
11	601318	中国平安	5,800	305,370.00	0.38
12	002645	华宏科技	39,800	271,436.00	0.34
13	600563	法拉电子	2,000	237,840.00	0.30
14	300369	绿盟科技	33,000	237,270.00	0.30
15	301033	迈普医学	4,500	189,225.00	0.24
16	688606	奥泰生物	2,745	173,758.50	0.22
17	002423	中粮资本	10,800	144,612.00	0.18
18	000039	中集集团	17,200	133,644.00	0.17
19	688711	宏微科技	7,072	122,204.16	0.15
20	688772	珠海冠宇	6,516	104,777.28	0.13
21	600770	综艺股份	23,000	96,370.00	0.12
22	002185	华天科技	4,900	56,889.00	0.07
23	688621	阳光诺和	1,505	56,738.50	0.07
24	002636	金安国纪	6,600	51,084.00	0.06
25	002533	金杯电工	4,400	43,296.00	0.05
26	002532	天山铝业	4,600	36,202.00	0.05
27	688328	深科达	1,942	29,091.16	0.04
28	000626	远大控股	3,000	17,250.00	0.02
29	688390	固德威	195	7,975.50	0.01
30	002507	涪陵榨菜	100	1,413.00	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	002745	木林森	3,525,341.00	4.50
2	600667	太极实业	2,786,307.00	3.55
3	300674	宇信科技	2,760,059.00	3.52
4	002773	康弘药业	2,715,157.00	3.46
5	002212	天融信	2,668,162.00	3.40
6	688100	威胜信息	2,656,305.86	3.39

7	002550	千红制药	2,625,144.00	3.35
8	600420	国药现代	2,584,368.00	3.30
9	601137	博威合金	2,580,769.00	3.29
10	601869	长飞光纤	2,577,997.00	3.29
11	603678	火炬电子	2,573,563.00	3.28
12	600409	三友化工	2,493,477.00	3.18
13	601222	林洋能源	2,358,002.00	3.01
14	603583	捷昌驱动	2,308,662.00	2.94
15	601311	骆驼股份	2,196,831.52	2.80
16	688289	圣湘生物	2,189,756.50	2.79
17	000065	北方国际	2,154,833.00	2.75
18	688403	汇成股份	2,151,305.53	2.74
19	603766	隆鑫通用	2,149,541.00	2.74
20	600267	海正药业	2,139,889.00	2.73
21	605222	起帆电缆	2,139,146.00	2.73
22	002645	华宏科技	2,134,670.00	2.72
23	000650	仁和药业	2,132,084.00	2.72
24	600761	安徽合力	2,130,736.86	2.72
25	002349	精华制药	2,129,783.00	2.72
26	603299	苏盐井神	2,128,518.00	2.71
27	603187	海容冷链	2,112,801.94	2.69
28	688389	普门科技	2,068,934.50	2.64
29	600643	爱建集团	2,067,043.00	2.64
30	688158	优刻得	2,043,376.76	2.61
31	000951	中国重汽	2,022,124.00	2.58
32	600835	上海机电	1,967,483.00	2.51
33	603328	依顿电子	1,936,168.00	2.47
34	603556	海兴电力	1,932,758.60	2.46
35	000810	创维数字	1,927,318.00	2.46
36	601163	三角轮胎	1,912,734.00	2.44
37	600273	嘉化能源	1,898,250.00	2.42
38	002701	奥瑞金	1,884,195.00	2.40
39	601857	中国石油	1,882,169.00	2.40
40	000528	柳工	1,864,652.00	2.38
41	002987	京北方	1,861,017.92	2.37
42	002649	博彦科技	1,843,724.00	2.35
43	600007	中国国贸	1,831,036.00	2.33
44	601138	工业富联	1,825,513.00	2.33
45	601567	三星医疗	1,819,595.00	2.32
46	603301	振德医疗	1,759,628.00	2.24
47	600797	浙大网新	1,745,516.00	2.23
48	000727	冠捷科技	1,744,150.00	2.22
49	600710	苏美达	1,734,137.00	2.21

50	601369	陕鼓动力	1,728,861.00	2.20
51	601126	四方股份	1,713,866.00	2.19
52	605123	派克新材	1,705,842.00	2.18
53	000681	视觉中国	1,669,617.00	2.13
54	002020	京新药业	1,669,462.00	2.13
55	002967	广电计量	1,658,864.00	2.12
56	300773	拉卡拉	1,658,163.00	2.11
57	603383	顶点软件	1,641,098.00	2.09
58	002782	可立克	1,622,997.00	2.07
59	002249	大洋电机	1,621,657.00	2.07
60	600718	东软集团	1,601,240.00	2.04
61	688408	中信博	1,572,459.65	2.01
62	002446	盛路通信	1,571,509.00	2.00

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603678	火炬电子	3,494,014.91	4.46
2	600667	太极实业	3,117,230.00	3.97
3	688100	威胜信息	3,014,905.70	3.84
4	601137	博威合金	2,892,250.00	3.69
5	600007	中国国贸	2,740,388.00	3.49
6	603583	捷昌驱动	2,726,034.00	3.48
7	600797	浙大网新	2,693,339.00	3.43
8	600420	国药现代	2,609,470.00	3.33
9	002745	木林森	2,531,478.00	3.23
10	603766	隆鑫通用	2,524,107.00	3.22
11	002773	康弘药业	2,476,818.00	3.16
12	688289	圣湘生物	2,423,197.54	3.09
13	600643	爱建集团	2,398,053.00	3.06
14	601869	长飞光纤	2,384,820.00	3.04
15	688158	优刻得	2,353,339.21	3.00
16	603301	振德医疗	2,331,852.00	2.97
17	603881	数据港	2,328,649.80	2.97
18	300674	宇信科技	2,322,875.00	2.96
19	600835	上海机电	2,314,209.00	2.95
20	600267	海正药业	2,227,915.00	2.84
21	601811	新华文轩	2,227,393.00	2.84
22	000650	仁和药业	2,218,853.00	2.83
23	603299	苏盐井神	2,218,049.00	2.83
24	603556	海兴电力	2,215,672.00	2.83

25	000969	安泰科技	2,213,516.00	2.82
26	601019	山东出版	2,153,651.00	2.75
27	601138	工业富联	2,145,669.00	2.74
28	002349	精华制药	2,141,656.00	2.73
29	605222	起帆电缆	2,116,717.00	2.70
30	002701	奥瑞金	2,080,630.00	2.65
31	603187	海容冷链	2,079,699.16	2.65
32	601949	中国出版	2,069,615.00	2.64
33	000065	北方国际	2,062,339.00	2.63
34	600761	安徽合力	2,061,423.00	2.63
35	002139	拓邦股份	2,037,092.00	2.60
36	002649	博彦科技	1,990,167.00	2.54
37	688389	普门科技	1,980,652.15	2.53
38	600718	东软集团	1,953,142.00	2.49
39	688403	汇成股份	1,953,118.77	2.49
40	000810	创维数字	1,941,969.00	2.48
41	601567	三星医疗	1,937,906.00	2.47
42	601857	中国石油	1,921,478.00	2.45
43	603328	依顿电子	1,914,157.00	2.44
44	601801	皖新传媒	1,905,039.00	2.43
45	601163	三角轮胎	1,879,142.00	2.40
46	003012	东鹏控股	1,876,200.00	2.39
47	600618	氯碱化工	1,873,910.00	2.39
48	601126	四方股份	1,863,414.00	2.38
49	000681	视觉中国	1,857,504.00	2.37
50	002051	中工国际	1,856,793.19	2.37
51	000811	冰轮环境	1,852,157.00	2.36
52	601222	林洋能源	1,837,436.00	2.34
53	600273	嘉化能源	1,833,332.90	2.34
54	605376	博迁新材	1,831,080.46	2.33
55	002706	良信股份	1,823,772.60	2.33
56	002545	东方铁塔	1,821,813.00	2.32
57	601952	苏垦农发	1,816,597.00	2.32
58	000915	华特达因	1,815,502.00	2.31
59	002402	和而泰	1,814,421.00	2.31
60	002106	莱宝高科	1,801,858.00	2.30
61	600409	三友化工	1,788,634.00	2.28
62	600710	苏美达	1,759,943.00	2.24
63	002645	华宏科技	1,759,279.00	2.24
64	002249	大洋电机	1,754,837.00	2.24
65	002782	可立克	1,746,209.00	2.23
66	000727	冠捷科技	1,745,996.00	2.23
67	601369	陕鼓动力	1,719,759.00	2.19

68	002212	天融信	1,710,560.00	2.18
69	002550	千红制药	1,706,715.00	2.18
70	688208	道通科技	1,699,739.55	2.17
71	603439	贵州三力	1,678,686.00	2.14
72	000550	江铃汽车	1,647,851.00	2.10
73	600389	江山股份	1,638,178.00	2.09
74	603915	国茂股份	1,624,454.00	2.07
75	002461	珠江啤酒	1,622,686.00	2.07
76	000902	新洋丰	1,611,414.00	2.05
77	300002	神州泰岳	1,597,664.00	2.04
78	002913	奥士康	1,593,479.00	2.03
79	000597	东北制药	1,578,793.00	2.01
80	002011	盾安环境	1,572,250.34	2.00

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

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	550,898,005.07
卖出股票收入（成交）总额	555,791,817.34

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,630,577.97	2.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,630,577.97	2.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	16,000	1,630,577.97	2.04

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国重汽集团济南卡车股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到滨州市交通运输局、内蒙古自治区交通运输厅、泗水县交通运输局、新疆生产建设兵团第八师交通运输局处罚的情况。

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

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

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	311,150.67
2	应收清算款	553,302.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	93,629.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	958,082.67

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 （户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证 1000 增强 A	3,403	7,333.00	3.29	-	24,954,183.81	100.00%
创金合信中	6,269	4,377.97	31,534.06	0.11%	27,413,944.	99.89%

证 1000 增 强 C					22	
合计	9,257	5,660.55	31,537.35	0.06%	52,368,128. 03	99.94%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证 1000 增强 A	105,293.01	0.42%
	创金合信中证 1000 增强 C	71,979.18	0.26%
	合计	177,272.19	0.34%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证 1000 增强 A	0~10
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证 1000 增强 A	0~10
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	6,309.55	0.01	-	-	-
基金经理等人员	25,921.53	0.05	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	32,231.08	0.06	0.00	0.00	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 22 日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	25,379,853.85	28,727,112.81
本报告期基金总申购份额	11,745,745.75	44,356,374.50
减：本报告期基金总赎回份额	12,171,412.50	45,638,009.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,954,187.10	27,445,478.28

§ 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

2024 年 7 月 1 日起，宋明华先生担任公司监事会主席；

2024 年 7 月 1 日起，郑晓敏女士担任公司职工监事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金自 2024 年起，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。本年度支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 18,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
山西证券	2	621,112,616.22	56.12%	84,997.56	28.42%	-
第一创业证券	4	485,577,206.19	43.88%	214,057.67	71.58%	-
金元证券	2	-	-	-	-	-

注：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、基金管理人将于 2025 年 3 月 31 日前，在官方网站公开披露旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况报告。该报告首次披露的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，包括在该期间内成立、清算、转型的公募基金。

4、本基金报告期内新租山西证券 2 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
山西证券	3,204,062.00	41.92%	-	-	-	-
第一创业证券	4,438,314.96	58.08%	7,600,000.00	100.00%	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下所有基金产品在直销柜台实施费率优惠的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-30
3	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-28
4	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
5	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（2024 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	2024-06-28
6	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
7	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
8	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-18
9	创金合信基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-06
10	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-29
11	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2024-10-24

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240227 - 20240326	0.00	23,827,780.71	23,827,780.71	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险: 1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。 2、大额赎回风险 (1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险; (2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响; (3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作; (4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 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.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日