创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金2026年第3季度报告

2026年09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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2026年10月26日

§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责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信气候变化责任投资股票
基金主代码	011146
交易代码	011146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	32,072,142.43 份
投资目标	本基金主要通过精选气候变化责任投资主题相关证券，在合理控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	创金合信气候变化责任投资股票 A	创金合信气候变化责任投资股票 C
下属分级基金的交易代码	011146	011147
报告期末下属分级基金的份额总额	19,610,838.33 份	12,461,304.10 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日－2026 年 9 月 30 日）	
	创金合信气候变化责任投资股票 A	创金合信气候变化责任投资股票 C
1.本期已实现收益	1,618,561.16	970,763.71
2.本期利润	-14,065,209.28	-8,414,473.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.7196	-0.6828
4.期末基金资产净值	26,853,014.88	16,675,067.06
5.期末基金份额净值	1.3693	1.3381

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。

3.2 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

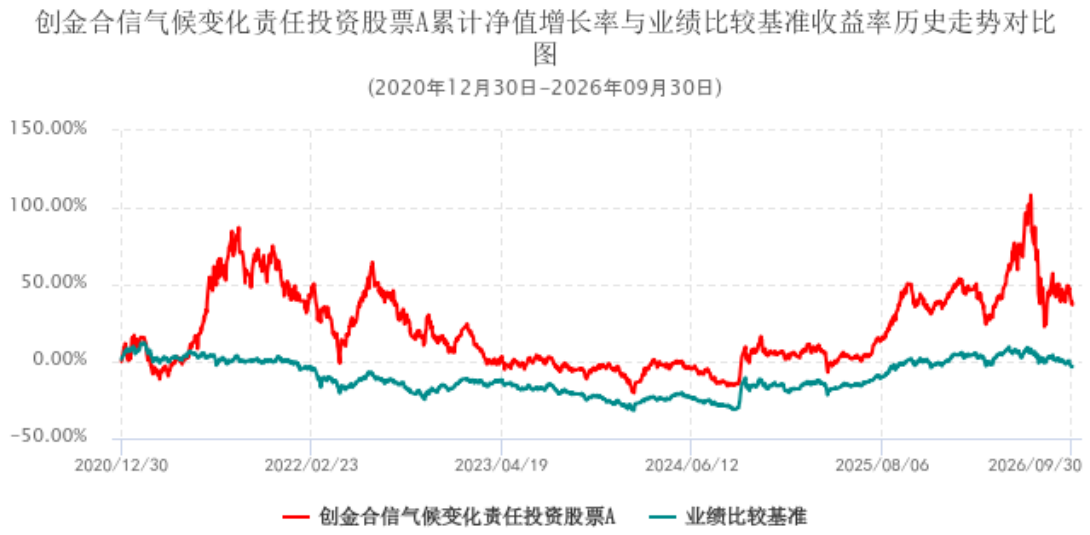
创金合信气候变化责任投资股票 A

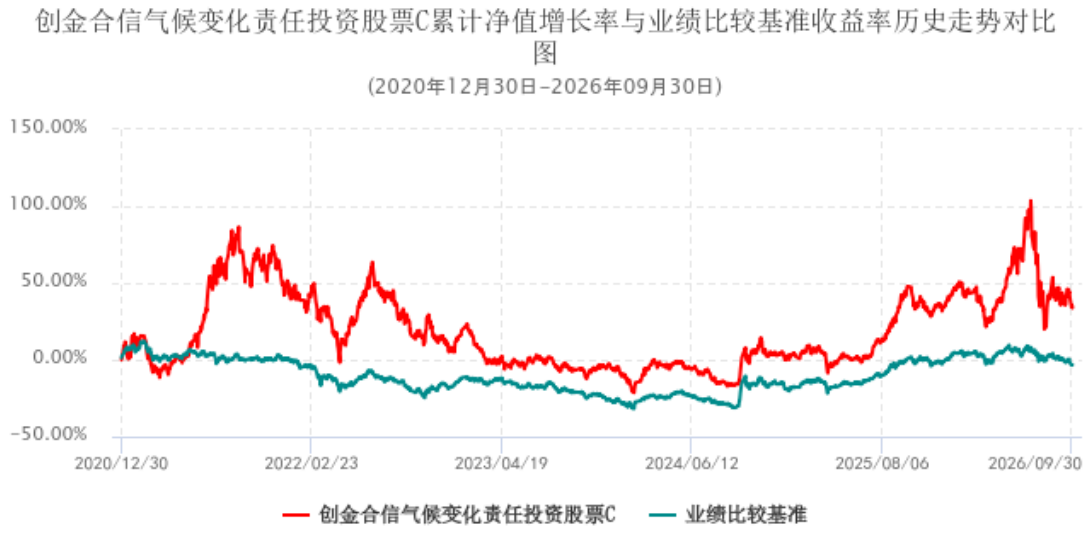
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-34.22%	4.06%	-10.53%	1.18%	-23.69%	2.88%
过去六个月	7.83%	3.45%	-1.49%	1.17%	9.32%	2.28%
过去一年	-8.96%	2.71%	-3.93%	1.06%	-5.03%	1.65%
过去三年	44.99%	1.96%	22.47%	1.07%	22.52%	0.89%
过去五年	-14.32%	1.98%	-3.16%	1.03%	-11.16%	0.95%
自基金合同生效起至今	36.93%	2.10%	-3.26%	1.03%	40.19%	1.07%

创金合信气候变化责任投资股票 C

阶段	净值增长率①	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	-34.29%	4.06%	-10.53%	1.18%	-23.76%	2.88%
过去六个月	7.61%	3.45%	-1.49%	1.17%	9.10%	2.28%
过去一年	-9.33%	2.71%	-3.93%	1.06%	-5.40%	1.65%
过去三年	43.25%	1.96%	22.47%	1.07%	20.78%	0.89%
过去五年	-16.02%	1.98%	-3.16%	1.03%	-12.86%	0.95%
自基金合同生效起至今	33.81%	2.10%	-3.26%	1.03%	37.07%	1.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张小郭	本基金基金经理、风格与行业投资研究部总监助理	2025 年 12 月 6 日	-	10	张小郭先生，中国国籍，清华大学硕士研究生，2016 年 7 月加入中国中投证券有限责任公司，任投资银行总部高级分析师，2017 年 3 月加入方正证券股份有限公司，任研究所机械行业研究员，2021 年 7 月加入通用技术集团投资管理有限公司，历任研究部制造组组长、证券投资部制造业务线投资经理，2022 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部基金经理助理，现任风格与行业投资研究部总监助理、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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场整体承压，结构分化显著，主要宽基指数普遍回落，上证综指下跌超 6%，沪深 300 指数下跌超 12%，深成指、创业板指下跌超过 20%，科创 50 指数下跌超过 30%。行业层面，银行、煤炭、石油等周期和防御类方向占优，电子、通信等前期高景气科技方向调整幅度较大。

报告期内，我们延续精选优质个股和高赔率景气赛道的策略，注重标的公司竞争实力和行业地位、所处赛道的景气前景和发展阶段，也重视标的公司的估值定价，在把握产业趋势与行业比较的基础上，精选个股，择优配置。

报告期内，本基金延续了之前的持仓结构，重配半导体设备及相关零部件、光通信产业链(含光模块、光器件、光通信设备等)、电子布、国产算力、人形机器人等方向上的优质个股。

报告期内，我们未因市场短期波动而改变对 AI 产业趋势的判断。报告期内，AI 产业链的板块景气度与股价出现明显背离：需求与盈利端延续强劲，海外算力资本开支持续扩张，光模块与光芯片订单延续高增长，电子布与覆铜板因 AI 服务器与高端载板需求拉动而量价齐升，半导体设备受存储扩产与先进制程投资支撑；而估值与交易层面，资金对科技成长的风险偏好显著收缩，前期涨幅较大的核心资产出现深度回调。我们认为，本轮的调整更多反映估值与拥挤度的修正，产业链“订单—产能—盈利”的兑现链条并未中断，部分细分方向在调整后已逐步进入配置性价比相对改善的价格区间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信气候变化责任投资股票 A 基金份额净值为 1.3693 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-34.22%，同期业绩比较基准收益率为-10.53%；截至本报告期末创金合信气候变化责任投资股票 C 基金份额净值为 1.3381 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-34.29%，同期业绩比较基准收益率为-10.53%。

4.6 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，本基金已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，该情形发生的时间范围为 2026 年 7 月 16 日起并延续至报告期末。

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	40,721,690.87	93.21
	其中：股票	40,721,690.87	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	605,194.19	1.39
	其中：债券	605,194.19	1.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,222,467.43	5.09
8	其他资产	139,209.61	0.32
9	合计	43,688,562.10	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,742,423.97 元，占净值比为 20.08%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	29,794,969.33	68.45
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	2,184,297.57	5.02
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	31,979,266.90	73.47

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
工业	1,467,941.12	3.37
信息技术	7,274,482.85	16.71
合计	8,742,423.97	20.08

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688627	精智达	8,476	3,583,652.80	8.23
2	H01888	建滔积层板	69,000	2,875,071.77	6.61
3	688361	中科飞测	6,931	2,419,542.79	5.56
4	688037	芯源微	6,592	2,157,363.84	4.96
5	688498	源杰科技	1,253	2,021,089.00	4.64
6	300776	帝尔激光	14,300	1,843,413.00	4.23
7	300308	中际旭创	2,200	1,778,568.00	4.09
8	H02631	天岳先进	26,500	1,546,872.84	3.55
9	300620	光库科技	5,700	1,541,736.00	3.54
10	H09880	优必选	23,000	1,467,941.12	3.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	605,194.19	1.39
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	605,194.19	1.39

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019827	26 国债 01	6,000	605,194.19	1.39

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未持有股指期货合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	37,670.65
2	应收清算款	51,263.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,275.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	139,209.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信气候变化责任投资股票 A	创金合信气候变化责任投资股票 C
报告期期初基金份额总额	20,740,633.11	12,722,840.22
报告期期间基金总申购份额	1,240,881.95	2,653,054.16
减：报告期期间基金总赎回份额	2,370,676.73	2,914,590.28

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	19,610,838.33	12,461,304.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§8 报告期末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	422,363.81	1.32	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	422,363.81	1.32	0.00	0.00	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金托管协议》；

3、创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金 2026 年 3 季度报告原文。

10.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道时代大街 200 号创金大厦 25-27、31 层

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日