创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

基金简称	创金合信季安鑫 3 个月	
基金主代码	002337	
交易代码	002337	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 9 日	
报告期末基金份额总额	672,361,689.00 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。	
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，本基金将投资组合的平均久期控制在 2 年以内，力争实现基金资产的稳健增值。	
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金、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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
下属分级基金的交易代码	002337	009459
报告期末下属分级基金的份额总额	20,128,101.33 份	652,233,587.67 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）	
	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
1.本期已实现收益	95,812.96	5,103,911.65
2.本期利润	116,350.16	5,290,337.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0081
4.期末基金资产净值	24,524,939.64	784,162,349.72
5.期末基金份额净值	1.2184	1.2023

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 本报告期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

创金合信季安鑫 3 个月 A

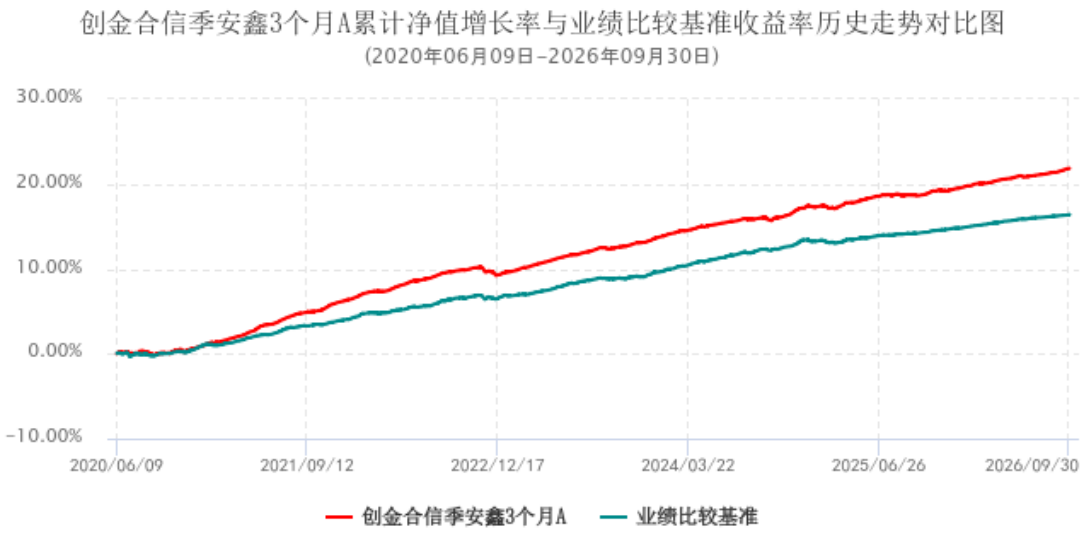
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.73%	0.01%	0.34%	0.01%	0.39%	0.00%
过去六个月	1.28%	0.01%	0.83%	0.01%	0.45%	0.00%
过去一年	2.70%	0.02%	1.90%	0.01%	0.80%	0.01%
过去三年	8.29%	0.02%	6.91%	0.02%	1.38%	0.00%
过去五年	16.07%	0.02%	12.53%	0.03%	3.54%	-0.01%
自基金转型日起至今	21.84%	0.03%	16.38%	0.03%	5.46%	0.00%

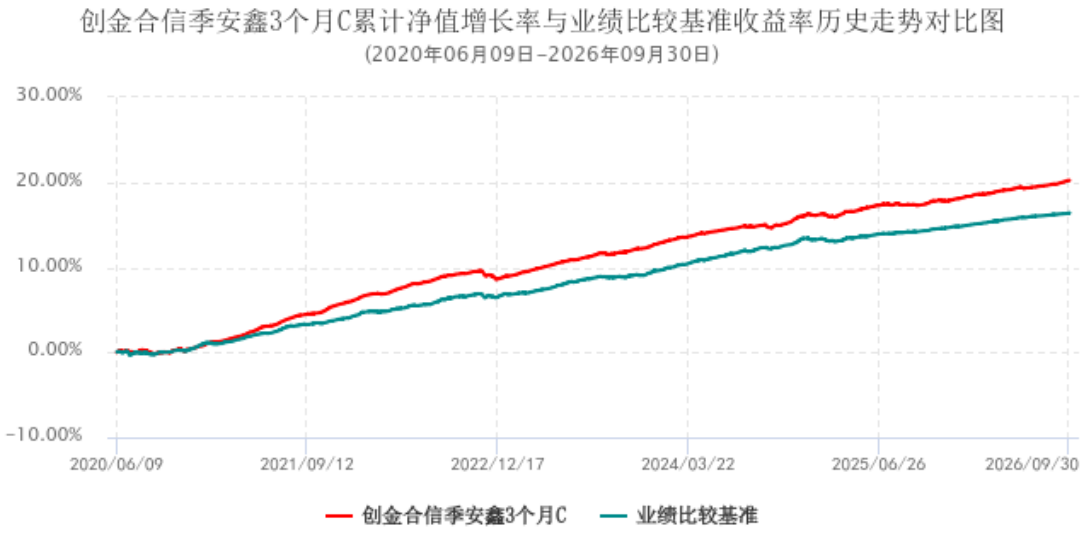
创金合信季安鑫 3 个月 C

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	0.69%	0.01%	0.34%	0.01%	0.35%	0.00%
过去六个月	1.19%	0.01%	0.83%	0.01%	0.36%	0.00%
过去一年	2.50%	0.02%	1.90%	0.01%	0.60%	0.01%
过去三年	7.67%	0.02%	6.91%	0.02%	0.76%	0.00%
过去五年	14.99%	0.02%	12.53%	0.03%	2.46%	-0.01%

自基金转型日起至今	20.23%	0.03%	16.38%	0.03%	3.85%	0.00%

3.2.2 自基金转型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		
闫一帆	本基金基金经	2026 年 8 月 27 日	-	16	闫一帆先生，中国国籍，新加坡南洋理工大学硕士。2008 年 7 月加入国泰君安

	理、固定收益总部、利率与衍生投资部负责人				证券股份有限公司，任机构销售，2011 年 5 月加入永安财产保险股份有限公司，任投资管理中心固定收益研究员，2012 年 10 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理部固定收益研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理、信用研究主管、固定收益部副总监、债券指数策略投资部负责人，现任固定收益总部负责人、利率与衍生投资部负责人、基金经理。
段伟兰	本基金基金经理	2026 年 1 月 16 日	-	10	段伟兰女士，中国国籍，中山大学硕士。2016 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固定收益交易员，现任基金经理、兼任投资经理。
黄佳祥	本基金基金经理	2021 年 2 月 3 日	-	9	黄佳祥先生，中国国籍，厦门大学博士。2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，现任基金经理。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
段伟兰	公募基金	2	61,758,508,657.78	2024-05-14
	私募资产管理计划	8	39,063,316,980.87	2022-11-08
	其他组合	-	-	-
	合计	10	100,821,825,638.65	-

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

2026 年三季度，债券市场表现分化，中长端收益率震荡下行呈现牛平，信用利差继续压缩，短端收益率窄幅震荡。三季度经济基本面延续 K 型分化、外需强于内需、供强需弱格局。央行保持适度宽松的货币政策配合定位，但仍关注债市防风险；灵活运用各类流动性工具，资金利率保持在政策利率附近运行。季度维度，DR001 主要在 1.35-1.43%区间窄幅波动，平稳的资金面限制了短端资产的下行空间，低风险环境下利好信用利差压缩、期限利差压缩。

三季度政府债供给加速，但净融资力度偏平缓，供给压力的预期逐步下修；往年三季度债市回调的历史规律压抑部分做多情绪；8 月股市走弱，风险偏好降低；9 月，政策逐步出台，但总体政策力度不超市场预期：3000 亿注资特别国债，用好地方政府债务结存限额、增加再贷款额度、结构性货币政策工具降息，购房贷款贴息政策等，总体利空因素弱于预期，政策端扰动因素逐步消退。债券需求方面，广义基金投债需求扩容，带动中低等级信用利差持续压缩，长端信用债下行幅度大于同期限利率债。三季度中长债收益率震荡下行，10 年国债下行约 6bp，30 年国债下行约 15bp，10 年大行二级资本债下行约 21bp，5 年 AAA 中票下行约 10bp，5 年中债隐含 AA 城投债下行 16bp。

展望四季度，预期经济基本面延续弱复苏格局，内需偏弱、外需高增，财政支出提速，经济增长目标达成压力一般，但融资需求仍相对偏弱；货币政策进入观察期，潜在的政策利率换锚预期将对应资金利率中枢下行从而打开短端债券的下行空间。债市供需方面，股市风险偏好下降，债市“资产荒”逻辑仍在，预期四季度债券市场呈现震荡偏强行情。在后续投资运作中，组合整体保持中性略偏高久期，关注高等级信用债和利率债，把握品种之间的结构性行情以及市场调整带来的交易机会。组合将结合当前及未来宏观政策形势变

化的判断，控制信用风险暴露情况，控制组合杠杆总体水平，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信季安鑫 3 个月 A 基金份额净值为 1.2184 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%；截至本报告期末创金合信季安鑫 3 个月 C 基金份额净值为 1.2023 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	886,549,149.33	89.61
	其中：债券	886,549,149.33	89.61
	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	100,004,169.26	10.11
	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	2,004,794.66	0.20
8	其他资产	774,651.39	0.08
9	合计	989,332,764.64	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	178,185,447.95	22.03
	其中：政策性金融债	111,402,906.85	13.78
4	企业债券	136,153,047.33	16.84
5	企业短期融资券	70,089,569.31	8.67
6	中期票据	352,275,514.53	43.56
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	149,845,570.21	18.53
9	其他	-	-
10	合计	886,549,149.33	109.63

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	112605098	26 建设银行 CD098	1,000,000	99,892,773.77	12.35
2	102683215	26 中铁武电 MTN001	700,000	70,261,232.33	8.69
3	240202	24 国开 02	600,000	61,196,728.77	7.57
4	240313	24 进出 13	500,000	50,206,178.08	6.21
5	102683627	26 中核二二 MTN001(绿色)	500,000	50,074,917.81	6.19

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序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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚的情况；中铁武汉电气化局集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到广东省深圳市住房和建设局处罚的情况；中国进出口银行出现在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局北京市分局处罚的情况；中国工商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚的情况。

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。

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

根据基金合同约定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,744.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	750,906.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	774,651.39

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
报告期期初基金份额总额	10,842,472.03	653,190,525.68
报告期期间基金总申购份额	9,862,327.92	52,718,343.07
减：报告期期间基金总赎回份额	576,698.62	53,675,281.08
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	20,128,101.33	652,233,587.67

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金 2026 年 3 季度报告原文。

9.2 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

9.3 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