金信中证800指数增强型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:金信基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26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07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金信中证 800 指数增强
基金主代码	027309
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 06 月 10 日
报告期末基金份额总额	224,035,977.13 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，在控制跟踪误差基础上，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，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。 本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过前述范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 （一）大类资产配置策略 本基金作为增强指数型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要

	求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 （二）股票投资策略 本基金为指数增强型基金，主要策略为复制标的指数，同时主动精选个股，选取基本面良好的股票构成投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越标的指数的投资收益。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略选取基本面良好的股票，在保持对基准指数有效跟踪的同时，力争实现对基准指数的长期超越。 （三）债券投资策略 本基金采用的债券投资策略包括：久期策略、期限结构策略、个券选择策略和相对价值判断策略等，对于可转换公司债等特殊品种，将根据其特点采取相应的投资策略。 为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、存托凭证，参与融资及转融通证券出借业务。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资于港股通标的股票，需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险，详见招募说明书。	
基金管理人	金信基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金信中证 800 指数增强 A	金信中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	027309	027310
报告期末下属分级基金的份额总额	153,997,031.83 份	70,038,945.30 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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	金信中证 800 指数增强 A	金信中证 800 指数增强 C
1.本期已实现收益	-2,208,933.01	-1,070,730.93
2.本期利润	-12,035,658.91	-5,649,014.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0762	-0.0763
4.期末基金资产净值	142,554,637.50	64,794,934.68
5.期末基金份额净值	0.9257	0.9251

注：1、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。

2、本报告所列示的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。

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

金信中证 800 指数增强 A 净值表现

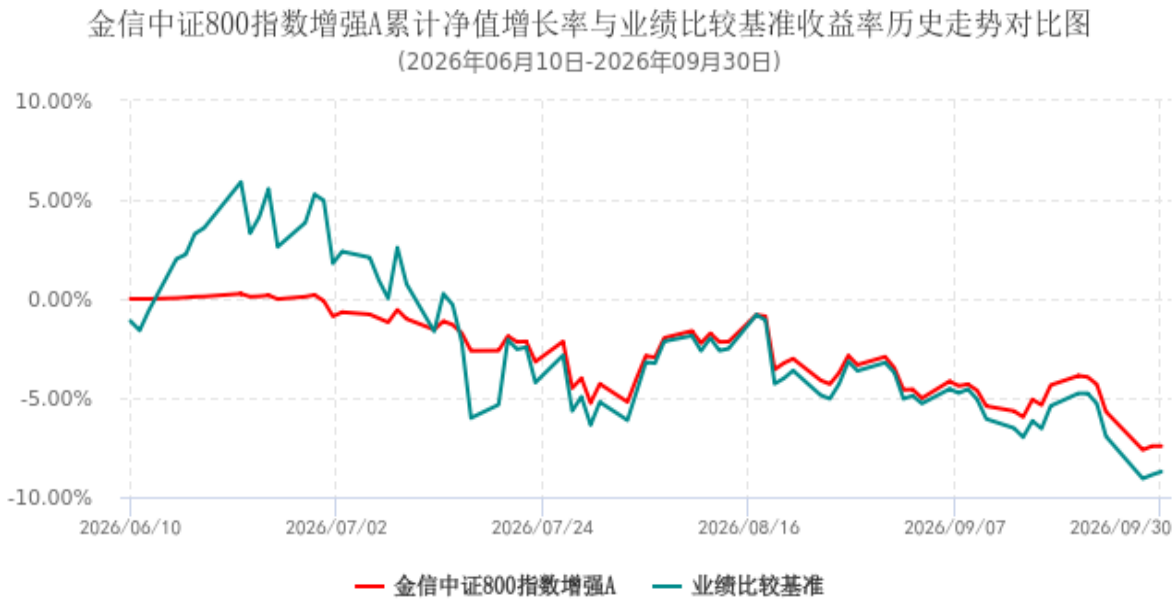
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.61%	0.83%	-13.29%	1.37%	5.68%	-0.54%
自基金合同生效起至今	-7.43%	0.76%	-8.72%	1.42%	1.29%	-0.66%

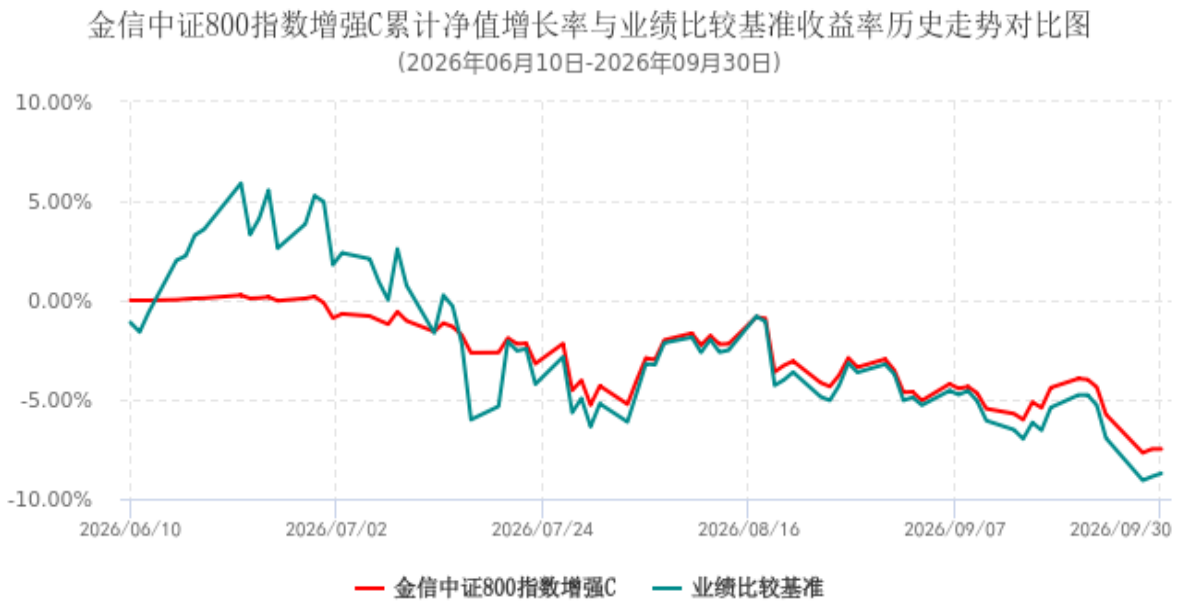
金信中证 800 指数增强 C 净值表现

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	-7.67%	0.83%	-13.29%	1.37%	5.62%	-0.54%
自基金合同生效起至今	-7.49%	0.76%	-8.72%	1.42%	1.23%	-0.66%

注：本基金基金合同于 2026 年 6 月 10 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

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





注：本基金基金合同于 2026 年 6 月 10 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末建仓期尚未结束。

3.3 其他指标

无。

§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		
黄飙	本基金的基金经理	2026-06-10	-	21 年	北京大学物理电子学硕士。曾任国信证券经济研究所固定收益分析师、国信证券经济研究所银行业分析师、长城证券金融研究所银行业首席分析师，消费服务组组长、长城证券资产管理部权

					益研究主管、长城证券资产管理部投资经理。现任金信基金管理有限公司基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内经济延续弱修复态势：生产端与出口保持韧性，物价温和回升，内需修复相对偏缓。制造业景气在季度前中段一度回落至收缩区间，9 月重返扩张，经济动能呈现边际企稳迹象。海外方面，受地缘政治与通胀预期扰动的影响，美联储年内首次加息 25 个基点，货币政策转向紧缩，且后续仍有加息预期，致使以 AI 为代表的全球风险资产阶段性承压；关税政策与中美经贸

关系的不确定性犹存，全球风险偏好走弱，流动性环境明显收紧。往后看，国内增量政策落地与企业盈利修复有望对冲海外紧缩压力，市场驱动力或逐步由估值扩张转向盈利验证。

A 股市场三季度整体大幅调整，风格结构剧烈再平衡，中证 800 指数全季下跌 14.0%。节奏上呈现“7 月急跌、8 月修复、9 月再度走弱”的三段式特征：7 月前期涨幅较大的科技成长方向集中回撤，中证 800 指数单月下跌 10.5%；8 月市场超跌反弹，中小盘风格弹性更大，中证 800 指数反弹 2.2%；9 月市场再度走弱，指数下跌 6.0%。全季来看，大盘价值显著跑赢小盘成长，成长类指数领跌，市场交易重心自上半年的产业趋势叙事切换至盈利验证与风格再平衡。行业表现分化明显，上半年极致演绎的 AI 算力与科技硬件主线明显回撤，电子、通信、建材等前期领涨行业跌幅居前，煤炭、农林牧渔、房地产、银行等低估值与内需方向相对抗跌乃至上涨。选股因子方面，价值、红利、低波动等大类因子表现占优，成长、动量、Beta 等因子显著回撤，因子有效性较上半年明显反转。

本基金于 2026 年 6 月 10 日成立，报告期内处于建仓期。作为中证 800 指数增强型基金，本基金以中证 800 指数成份股及备选成份股为主要投资范围，采用多因子量化选股模型，通过多维度因子对个股进行综合评价与超低配调整，严格控制组合相对基准的行业偏离、风格偏离与跟踪误差，力求在有效跟踪基准的同时获取稳健的超额收益。运作层面，报告期内本基金按照基金合同约定有序推进建仓工作，权益仓位自低位逐步提升；面对三季度市场的大幅调整，建仓期内相对较低的仓位水平有效缓冲了指数下行对组合净值的冲击。

报告期内，本基金持续跟踪因子有效性并迭代优化模型，动态调整组合的行业与风格暴露，不断完善组合优化与风险控制流程，严格控制跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金信中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 0.9257 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.61%，同期业绩比较基准收益率为-13.29%；截至报告期末金信中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 0.9251 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.67%，同期业绩比较基准收益率为-13.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现持有人数或基金资产净值预警的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	174,419,898.15	84.01
	其中：股票	174,419,898.15	84.01
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	8,350.88	0.00
	其中：债券	8,350.88	0.00
	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	33,022,324.87	15.91
8	其他资产	170,091.50	0.08
9	合计	207,620,665.40	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（指数投资）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	2,271,429.00	1.1
B	采矿业	10,567,478.00	5.1
C	制造业	97,388,049.29	46.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,672,563.00	3.7
E	建筑业	5,303,108.00	2.56
F	批发和零售业	500,634.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,382,230.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,491,846.47	4.1
J	金融业	30,669,487.00	14.79
K	房地产业	31,350.00	0.02
L	租赁和商务服务业	400,019.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	3,438,366.00	1.66
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	310,716.00	0.15

S	综合	-	-
	合计	169,427,275.76	81.71

5.2.2 报告期末（积极投资）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	4,013,190.37	1.94
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	979,432.02	0.47
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	4,992,622.39	2.41

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

5.3.1 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	600900	长江电力	263,000	7,506,020.00	3.62

2	601668	中国建筑	1,209,000	5,247,060.00	2.53
3	601939	建设银行	453,500	5,015,710.00	2.42
4	300308	中际旭创	5,700	4,608,108.00	2.22
5	600519	贵州茅台	3,500	4,405,170.00	2.12
6	300750	宁德时代	14,707	4,281,354.77	2.06
7	601899	紫金矿业	112,700	3,357,333.00	1.62
8	601288	农业银行	445,500	3,105,135.00	1.50
9	688498	源杰科技	1,800	2,903,400.00	1.40
10	601166	兴业银行	153,900	2,777,895.00	1.34

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688809	强一股份	2,436	1,190,327.04	0.57
2	688103	国力电子	14,168	1,076,484.64	0.52
3	688515	裕太微	7,119	979,432.02	0.47
4	688502	茂莱光学	2,409	973,236.00	0.47
5	688371	菲沃泰	35,449	773,142.69	0.37

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	-	-
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）	8,350.88	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,350.88	0.00

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	118071	华峰转债	40	8,350.88	0.00

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

中国建设银行股份有限公司于 2026 年 9 月 23 日因违反规定办理资本项目资金收付；违反规定

办理结汇、售汇业务等，被国家外汇管理局北京市分局罚款1577.06万元；于2026年06月05日因重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等，被国家金融监督管理总局罚款70万元；

兴业银行股份有限公司于2025年12月5日因外包机构管理不到位、企业划型不准确等原因，被国家金融监督管理总局罚款720万元；

中国农业银行股份有限公司于2025年10月31日因相关产品销售、服务收费不合规,信贷资金流向管理不审慎等，被国家金融监督管理总局罚款2720万元。

除上述证券的发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期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。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	170,091.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	170,091.50

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	金信中证 800 指数增强 A	金信中证 800 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	165,774,207.45	79,608,871.25
报告期期间基金总申购份额	3,818,870.17	484,064.74
减：报告期期间基金总赎回份额	15,596,045.79	10,053,990.69
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	153,997,031.83	70,038,945.30

§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

基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或者超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予金信中证 800 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；

2、《金信中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《金信中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室

深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

9.3 查阅方式

本基金管理人公司网站，网址：www.jxfunds.com.cn。

金信基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日