创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金 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：中国工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。

基金托管人中国工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	创金合信量化发现混合	
基金主代码	003241	
交易代码	003241	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日	
报告期末基金份额总额	29,104,266.87 份	
投资目标	本基金运用数量化投资模型指导资产配置和股票选择决策，力争持续获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的方式，以宏观经济数据、上市公司相关数据、资本/资金市场相关数据为研究与分析对象，建立数量化投资模型，指导资产配置和股票选择决策。一方面，本基金基于对资本市场参与主体行为趋势的研究，从"自上而下"的角度进行资产配置；另一方面，本基金采用量化选股模型，从与上市公司相关的数据中发现有价值的信息，以"自下而上"的视角精选股票投资组合。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为混合型基金。长期来看，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化发现混合 A	创金合信量化发现混合 C

下属分级基金的交易代码	003241	003242
报告期末下属分级基金的份额总额	20,245,051.64 份	8,859,215.23 份

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金的业绩比较基准由原来的"中证 500 指数收益率*80%+银行人民币活期存款利率(税后)*20%"变更为"中证 500 指数收益率*85%+中债-综合全价(总值）指数收益率*15%"。上述事项已于 2026 年 6 月 26 日在指定媒体上公告。

§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）	
	创金合信量化发现混合 A	创金合信量化发现混合 C
1.本期已实现收益	-1,312,509.11	-554,435.94
2.本期利润	1,683,662.98	644,859.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0830	0.0726
4.期末基金资产净值	29,196,980.77	11,781,917.99
5.期末基金份额净值	1.4422	1.3299

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

创金合信量化发现混合 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	6.15%	1.25%	-14.25%	1.64%	20.40%	-0.39%
过去六个月	-4.77%	1.20%	-1.59%	1.51%	-3.18%	-0.31%
过去一年	-1.86%	1.16%	0.81%	1.35%	-2.67%	-0.19%
过去三年	5.33%	1.20%	25.87%	1.27%	-20.54%	-0.07%
过去五年	-9.62%	1.16%	6.09%	1.14%	-15.71%	0.02%
过去七年	64.67%	1.18%	43.06%	1.12%	21.61%	0.06%

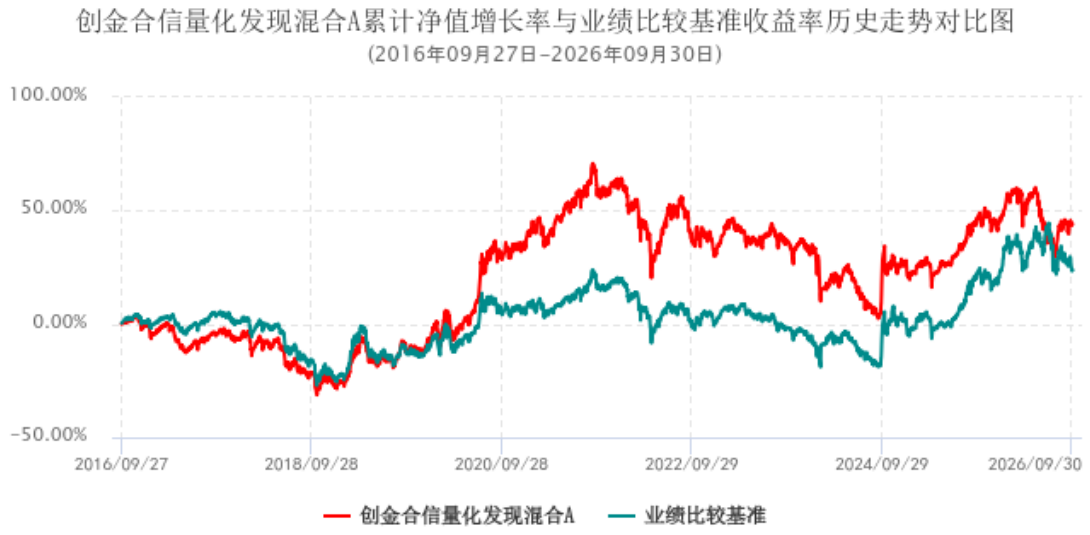
过去十年	43.89%	1.14%	22.82%	1.08%	21.07%	0.06%
自基金合同生效起至今	44.22%	1.14%	23.85%	1.08%	20.37%	0.06%

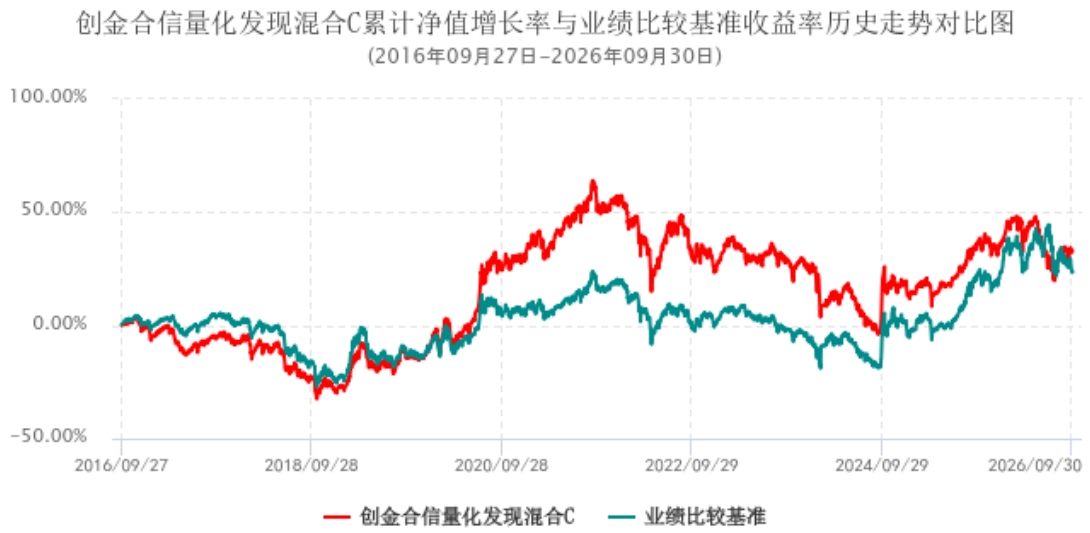
创金合信量化发现混合 C

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	5.93%	1.26%	-14.25%	1.64%	20.18%	-0.38%
过去六个月	-5.16%	1.20%	-1.59%	1.51%	-3.57%	-0.31%
过去一年	-2.66%	1.16%	0.81%	1.35%	-3.47%	-0.19%
过去三年	2.82%	1.20%	25.87%	1.27%	-23.05%	-0.07%
过去五年	-13.18%	1.16%	6.09%	1.14%	-19.27%	0.02%
过去七年	55.67%	1.18%	43.06%	1.12%	12.61%	0.06%
过去十年	32.70%	1.14%	22.82%	1.08%	9.88%	0.06%
自基金合同生效起至今	32.99%	1.14%	23.85%	1.08%	9.14%	0.06%

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金的业绩比较基准由原来的"中证 500 指数收益率*80%+银行人民币活期存款利率（税后）*20%"变更为"中证 500 指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%"。上述事项已于 2026 年 6 月 26 日在指定媒体上公告。

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		
黄小虎	本基金基金经理	2025 年 11 月 19 日	-	8	黄小虎先生，中国国籍，香港城市大学博士。2017 年 12 月加入安信证券股份有限公司，任信息技术中心数据挖掘岗，2018 年 10 月加入大成基金管理有限公司，历任战略发展部助理研究员、数量与指数投资部研究员，2021 年 1 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
李添峰	本基金基金经理、量化指数部总监助理	2021 年 11 月 16 日	-	14	李添峰先生，中国国籍，中国人民大学硕士。2012 年 7 月加入国海证券股份有限公司，历任证券资产管理分公司量化投资研究员、产品经理，2015 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、指数策略投资研究部投资经理、组合风险研究与服务部投资风险研究员、量化指数与国际部投资经理，现任量化指数部总监助理、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

2026 年三季度 A 股市场风格发生较大幅度的切换，二季度大涨的电子、通信等科技板块下跌，而非科技板块如红利、小市值风格获得资金流入企稳回升。尽管三季度指数整体表现不佳，但个股机会较之前有所增加，量化策略的表现有所回暖。

本基金采用量化多策略的运作思路，希望通过配置具有差异化的量化选股策略来降低基金的整体波动和回撤，提升投资者的持有体验。当前在多策略框架下包括全市场选股策略、大盘选股策略、中小盘选股策略、红利选股策略和自由现金流选股策略等不同风格。三季度表现来看，科技股调整后资金在其他板块寻找机会，市场机会增加，产品所采用策略的表现均有所回暖，其中小市值策略修复较快。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信量化发现混合 A 基金份额净值为 1.4422 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.15%，同期业绩比较基准收益率为-14.25%；截至本报告期末创金合信量化发现混合 C 基金份额净值为 1.3299 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.93%，同期业绩比较基准收益率为-14.25%。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 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	37,729,234.23	91.27
	其中：股票	37,729,234.23	91.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,708,410.01	4.13
	其中：债券	1,708,410.01	4.13
	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	1,613,080.08	3.90
8	其他资产	285,140.00	0.69
9	合计	41,335,864.32	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

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	435,754.00	1.06

B	采矿业	1,512,033.00	3.69
C	制造业	24,394,079.99	59.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	720,081.00	1.76
E	建筑业	593,551.00	1.45
F	批发和零售业	1,369,431.00	3.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,447,914.00	3.53
H	住宿和餐饮业	59,438.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,757,759.59	4.29
J	金融业	2,785,487.00	6.80
K	房地产业	525,615.00	1.28
L	租赁和商务服务业	379,197.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	607,479.65	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	358,015.00	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	271,359.00	0.66
Q	卫生和社会工作	83,148.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	305,727.00	0.75
S	综合	123,165.00	0.30
	合计	37,729,234.23	92.07

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

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	601318	中国平安	16,700	889,943.00	2.17
2	600295	鄂尔多斯	65,600	856,736.00	2.09
3	603897	长城科技	27,800	822,324.00	2.01
4	601225	陕西煤业	30,500	793,915.00	1.94
5	601919	中远海控	48,300	790,671.00	1.93
6	601339	百隆东方	108,300	785,175.00	1.92
7	002322	理工能科	65,700	779,202.00	1.90
8	600901	江苏金租	99,100	687,754.00	1.68
9	601088	中国神华	14,000	669,200.00	1.63
10	300628	亿联网络	16,500	651,585.00	1.59

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	1,506,176.30	3.68
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）	202,233.71	0.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,708,410.01	4.17

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	019835	26 国债 09	15,000	1,506,176.30	3.68
2	113042	上银转债	50	5,873.65	0.01
3	110100	龙建转债	50	5,825.26	0.01
4	123088	威唐转债	50	5,742.99	0.01
5	113052	兴业转债	50	5,659.07	0.01

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 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。

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，浙江长城电工科技股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到江苏省交通运输综合行政执法监督局处罚的情况；江苏金融租赁股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到滨海县交通运输局、国家金融监督管理总局江苏监管局处罚的情况；中国神华能源股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到榆林市能源局、国家矿山安全监察局陕西局、鄂尔多斯市应急管理局、鄂尔多斯市伊金霍洛旗住房和城乡规划建设局、伊金霍洛旗自然资源局、鄂尔多斯市生态环境局处罚的情况。

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

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	13,585.06
2	应收清算款	271,096.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	457.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	285,140.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	5,873.65	0.01
2	110100	龙建转债	5,825.26	0.01
3	123088	威唐转债	5,742.99	0.01
4	113052	兴业转债	5,659.07	0.01
5	127030	盛虹转债	5,620.30	0.01
6	123107	温氏转债	5,574.77	0.01
7	128142	新乳转债	5,536.40	0.01
8	113681	镇洋转债	5,459.36	0.01
9	127049	希望转 2	5,416.39	0.01
10	113631	皖天转债	5,244.00	0.01
11	110084	贵燃转债	5,167.47	0.01
12	113661	福 22 转债	5,155.56	0.01
13	123149	通裕转债	5,134.25	0.01
14	123133	佩蒂转债	5,115.22	0.01
15	113640	苏利转债	5,106.60	0.01
16	111017	蓝天转债	5,085.38	0.01
17	113058	友发转债	5,072.39	0.01
18	113062	常银转债	5,071.82	0.01
19	123144	裕兴转债	5,031.53	0.01
20	127059	永东转 2	5,024.46	0.01
21	113056	重银转债	5,013.28	0.01
22	123142	申昊转债	4,988.65	0.01
23	127060	湘佳转债	4,942.35	0.01
24	123104	卫宁转债	4,919.29	0.01
25	113054	绿动转债	4,910.80	0.01
26	113070	渝水转债	4,902.89	0.01
27	127046	百润转债	4,895.15	0.01
28	123080	海波转债	4,884.78	0.01
29	127056	中特转债	4,840.18	0.01
30	127034	绿茵转债	4,831.30	0.01
31	127054	双箭转债	4,822.61	0.01
32	127050	麒麟转债	4,754.33	0.01
33	123119	康泰转 2	4,745.28	0.01
34	127040	国泰转债	4,628.68	0.01
35	118034	晶能转债	4,627.57	0.01
36	123092	天壕转债	4,619.78	0.01
37	127089	晶澳转债	4,567.86	0.01
38	127031	洋丰转债	4,528.12	0.01
39	123175	百畅转债	4,520.48	0.01
40	113043	财通转债	4,373.46	0.01

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	创金合信量化发现混合 A	创金合信量化发现混合 C
报告期期初基金份额总额	20,415,965.06	9,056,102.18
报告期期间基金总申购份额	88,997.28	200,280.80
减：报告期期间基金总赎回份额	259,910.70	397,167.75
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	20,245,051.64	8,859,215.23

§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

单位：份

项目	创金合信量化发现混合 A	创金合信量化发现混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,520,032.22	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,520,032.22	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	27.27	-

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

根据基金合同相关约定，本基金股票投资占基金资产的比例上限高于 80%，结合本基金的投资策略和市场情况，本基金股票投资占基金资产的比例可能阶段性或长期高于 80%，将面临着较高的市场波动和投资风险，请投资者充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金 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