创金合信泰博66个月定期开放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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	创金合信泰博 66 个月定开债券
基金主代码	009833
交易代码	009833
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 27 日
报告期末基金份额总额	7,856,906,490.62 份
投资目标	本基金采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的资产，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。
业绩比较基准	封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	33,115,151.25
2.本期利润	33,115,151.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042
4.期末基金资产净值	8,181,148,645.82
5.期末基金份额净值	1.0413

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；

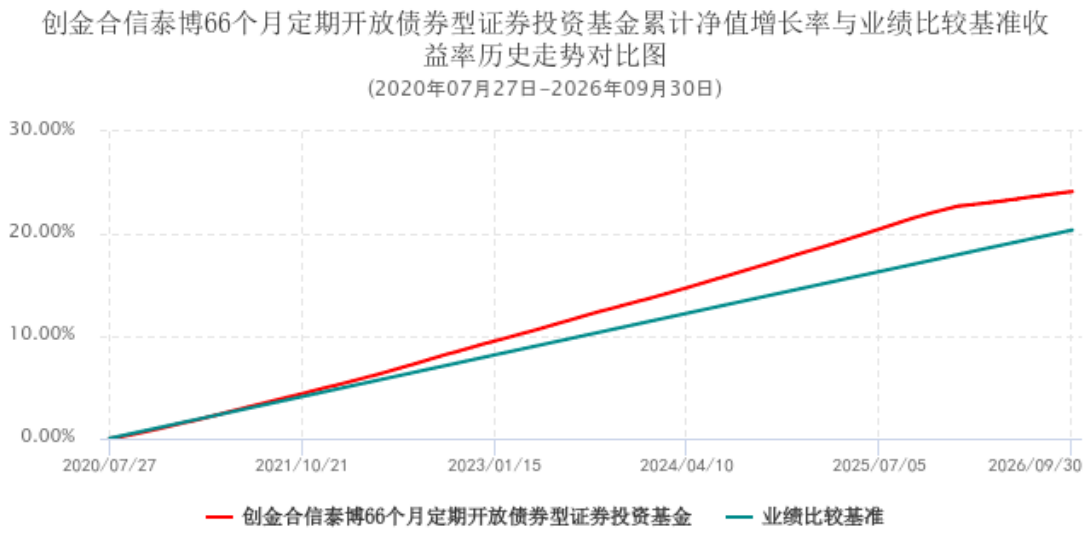
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	0.40%	0.01%	0.82%	0.01%	-0.42%	0.00%
过去六个月	0.83%	0.01%	1.63%	0.01%	-0.80%	0.00%
过去一年	2.05%	0.01%	3.27%	0.01%	-1.22%	0.00%
过去三年	10.30%	0.01%	9.87%	0.01%	0.43%	0.00%
过去五年	19.15%	0.01%	16.46%	0.01%	2.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.13%	0.01%	20.37%	0.01%	3.76%	0.00%

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		
孙霄宇	本基金基金经理	2023 年 2 月 7 日	-	13	孙霄宇先生，中国国籍，德国耶拿大学硕士。2013 年 4 月加入宁波银行，任金融市场部代客交易员，2014 年 4 月加入中银国际期货有限责任公司，任研究部高级研究员，2016 年 5 月加入张家港农村商业银行，任金融市场部投资经理，2020 年 8 月加入甬兴证券有限公司，任固定收益部自营投资主管、投资经理，2022 年 5 月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理、兼任投资经理。
闫一帆	本基金基金经理、固定收益总部、利率与衍生投资部负责人	2020 年 7 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。

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

三季度基本面弱修复、政策季末加码宽松，债市走出长端领涨的“牛平”行情。基本面上呈“生产强、内需弱”。工业和出口均维持较好增长，消费和投资偏弱。人民币季内升破 6.7，创 2022 年 7 月以来新高。政策上，7 月底政治局会议释放宽松信号；季末组合拳落地：PSL 降息 25bp 至 1.5%、结构性工具扩容、房贷贴息；总量降息降准缺席。资金面平稳，围绕政策利率窄幅波动。10 年期国债收益率三季度下行约 5bp 至 1.68%；30 年期下行约 14bp，创年内新低；30Y-10Y 利差大幅收窄至 40bp 附近的年内低点，曲线平坦化。产品为摊余成本法产品，截止三季度末已经完成新一轮建仓，主要配置期限与 66 个月相匹配的

金融债，包括政策性银行金融债和券商债。本报告期内主要根据资金面情况，优化回购期限结构，尽量降低组合回购成本。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信泰博66个月定开债券基金份额净值为1.0413元，本报告期内，份额净值增长率为0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.82%。

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	14,069,781,340.06	98.26
	其中：债券	14,069,781,340.06	98.26
	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	249,724,702.87	1.74
8	其他资产	146,915.70	0.00
9	合计	14,319,652,958.63	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	14,069,781,340.06	171.98
	其中：政策性金融债	9,038,403,594.04	110.48
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	14,069,781,340.06	171.98

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	210210	21 国开 10	31,100,000	3,370,374,877.05	41.20
2	210405	21 农发 05	19,600,000	2,135,730,679.71	26.11
3	210310	21 进出 10	16,800,000	1,815,553,434.62	22.19
4	260203	26 国开 03	12,200,000	1,236,204,384.36	15.11
5	250355	25 进出 55	4,800,000	480,540,218.30	5.87

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

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，中国农业发展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；北京农村商业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北京监管局、中国人民银行北京市分行处罚的情况；国投证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行处罚的情况。

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	139,086.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	7,828.93
8	其他	-
9	合计	146,915.70

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

报告期期初基金份额总额	7,856,900,391.99
报告期期间基金总申购份额	6,098.63
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	7,856,906,490.62

§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

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	20260701 - 20260930	2,499,999,000.00	0.00	0.00	2,499,999,000.00	31.82%
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。							

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、《创金合信泰博 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信泰博 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信泰博 66 个月定期开放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