创金合信量化多因子股票型证券投资基金 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	创金合信量化多因子股票	
基金主代码	002210	
交易代码	002210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 22 日	
报告期末基金份额总额	152,538,457.78 份	
投资目标	在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金为股票型基金，股票投资部分占基金资产的比例不低于 80%。本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。	
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	002210	003865
报告期末下属分级基金的份	125,152,589.19 份	27,385,868.59 份

额总额		

§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）	
	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C
1.本期已实现收益	-12,683,579.62	-2,023,881.08
2.本期利润	-32,639,647.53	-1,802,147.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2270	-0.0827
4.期末基金资产净值	192,654,889.68	38,112,188.85
5.期末基金份额净值	1.5394	1.3917

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

创金合信量化多因子股票 A

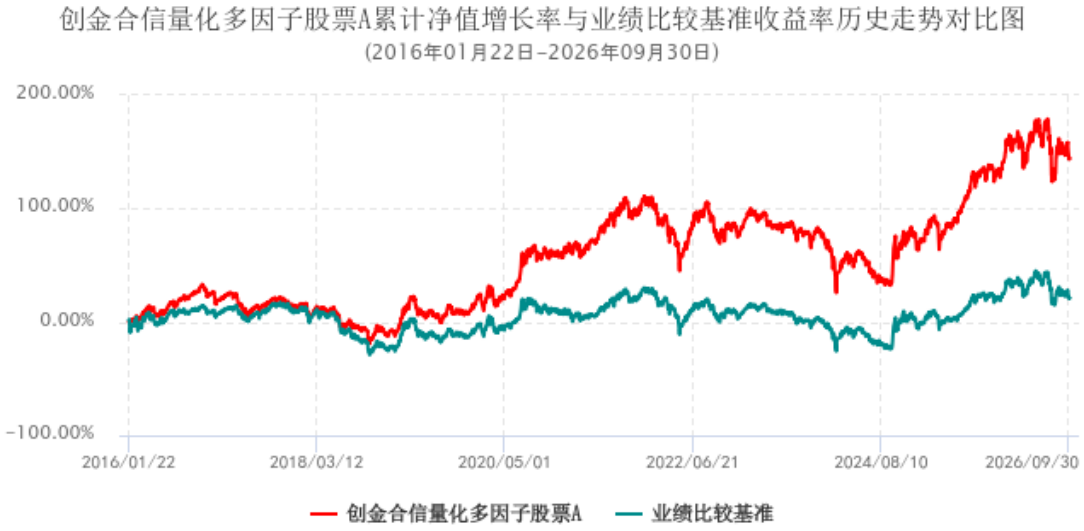
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.21%	2.02%	-15.46%	1.87%	3.25%	0.15%
过去六个月	0.11%	1.82%	-3.59%	1.69%	3.70%	0.13%
过去一年	4.13%	1.57%	-2.96%	1.49%	7.09%	0.08%
过去三年	35.78%	1.60%	19.20%	1.57%	16.58%	0.03%
过去五年	23.24%	1.46%	0.25%	1.42%	22.99%	0.04%
过去七年	127.35%	1.43%	37.82%	1.40%	89.53%	0.03%
过去十年	99.34%	1.38%	11.49%	1.35%	87.85%	0.03%
自基金合同生效起至今	143.99%	1.36%	20.96%	1.37%	123.03%	-0.01%

创金合信量化多因子股票 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	-12.38%	2.02%	-15.46%	1.87%	3.08%	0.15%

过去六个月	-0.27%	1.82%	-3.59%	1.69%	3.32%	0.13%
过去一年	3.35%	1.57%	-2.96%	1.49%	6.31%	0.08%
过去三年	32.57%	1.59%	19.20%	1.57%	13.37%	0.02%
过去五年	18.54%	1.46%	0.25%	1.42%	18.29%	0.04%
过去七年	115.51%	1.43%	37.82%	1.40%	77.69%	0.03%
自基金合同生效起至今	79.99%	1.39%	9.77%	1.36%	70.22%	0.03%

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	2022 年 7 月 29 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。
董梁	本基金基金经理、首席量化投资官、量化指数部负责人	2019 年 7 月 5 日	-	22	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学博士。2003 年 12 月加入 UNX Inc 任分析师，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理，2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理，2015 年 1 月加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理，2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官、量化指数部负责人、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

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。

2026年三季度，基金的业绩基准中证1000指数下跌17.15%。基准指数成份股内，表现较好的行业是银行 16.82%、煤炭 15.49%、农林牧渔 14.64%，表现较差的行业是电子-31.91%、通信-30.15%、建材-24.16%。风格方面，低估值和交易因子整体占优，三季度对组合超额贡献较多的风格因子包括贝塔因子和流动性因子。

报告期内模型运行平稳，我们坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格控制各个维度上的风险暴露以限制跟踪误差，突出对中小股票的风险监测，在此基础上追求超额收益。

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多因子股票 A 基金份额净值为 1.5394 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.21%，同期业绩比较基准收益率为-15.46%；截至本报告期末创金合信量化多因子股票 C 基金份额净值为 1.3917 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.38%，同期业绩比较基准收益率为-15.46%。

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	191,912,114.02	82.59
	其中：股票	191,912,114.02	82.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,147,077.53	4.80
	其中：债券	11,147,077.53	4.80
	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	25,552,538.12	11.00
8	其他资产	3,768,986.67	1.62
9	合计	232,380,716.34	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	-	-
B	采矿业	4,904,613.38	2.13
C	制造业	138,404,383.81	59.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,283,373.84	1.86
E	建筑业	1,812,980.00	0.79
F	批发和零售业	1,335,741.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	3,719,504.00	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,395,829.93	8.40
J	金融业	10,075,987.25	4.37
K	房地产业	608,372.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,755,270.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	3,186,967.25	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	2,301,155.22	1.00
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	127,936.34	0.06

S	综合	-	-
	合计	191,912,114.02	83.16

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	688110	东芯股份	28,309	3,221,847.29	1.40
2	688536	思瑞浦	9,591	3,136,257.00	1.36
3	688766	普冉股份	8,482	3,025,020.48	1.31
4	002222	福晶科技	48,300	2,928,912.00	1.27
5	002497	雅化集团	183,800	2,885,660.00	1.25
6	301511	德福科技	29,400	2,800,350.00	1.21
7	601777	千里科技	339,300	2,775,474.00	1.20
8	002979	雷赛智能	52,100	2,733,687.00	1.18
9	688639	华恒生物	142,699	2,726,977.89	1.18
10	600120	浙江东方	578,945	2,692,094.25	1.17

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	11,147,077.53	4.83
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	11,147,077.53	4.83

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	019792	25 国债 19	110,000	11,147,077.53	4.83

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IM2612	IM2612	15	21,526,800.00	-519,840.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-519,840.00
股指期货投资本期收益（元）					-2,706,832.74
股指期货投资本期公允价值变动（元）					129,880.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

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

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	2,684,172.66
2	应收清算款	962,746.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	122,067.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,768,986.67

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	创金合信量化多因子股票 A	创金合信量化多因子股票 C
报告期期初基金份额总额	156,218,170.90	12,362,715.68
报告期期间基金总申购份额	8,988,254.47	18,615,802.53
减：报告期期间基金总赎回份额	40,053,836.18	3,592,649.62
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	125,152,589.19	27,385,868.59

§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、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信量化多因子股票型证券投资基金 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