创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金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

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信沪深 300 增强
基金主代码	002310
交易代码	002310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 31 日
报告期末基金份额总额	146,924,948.67 份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。 1、股票投资策略 本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。 （1）多因子模型

	多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。 （2）投资组合优化模型 在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，根据多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化器，构建风险调整后的最优投资组合。 2、债券投资策略 本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。 3、可转换债券及可交换债券投资策略 可转换债券及可交换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。 4、存托凭证的投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述上市交易的股票投资策略执行，在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 5、衍生产品投资策略 （1）股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。 （2）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本基金将按届时

	有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。 6、融资、转融通证券出借业务投资策略 本基金将在法律法规允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资与转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、出借证券流动性等因素的基础上合理确定范围、期限和比例，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。 7、其他 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%＋一年期人民币定期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
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	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	002310	002315
报告期末下属分级基金的份额总额	57,342,262.26 份	89,582,686.41 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）	
	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
1.本期已实现收益	1,229,266.56	1,693,773.11
2.本期利润	-4,992,642.76	-6,306,957.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0847	-0.0699
4.期末基金资产净值	97,403,376.95	151,264,860.21
5.期末基金份额净值	1.6986	1.6886

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 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

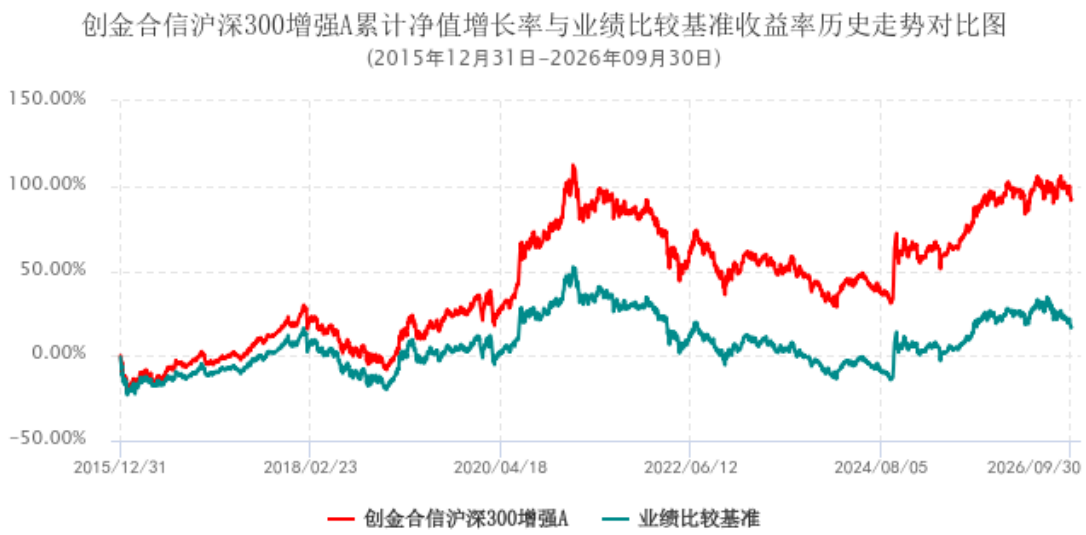
创金合信沪深 300 增强 A

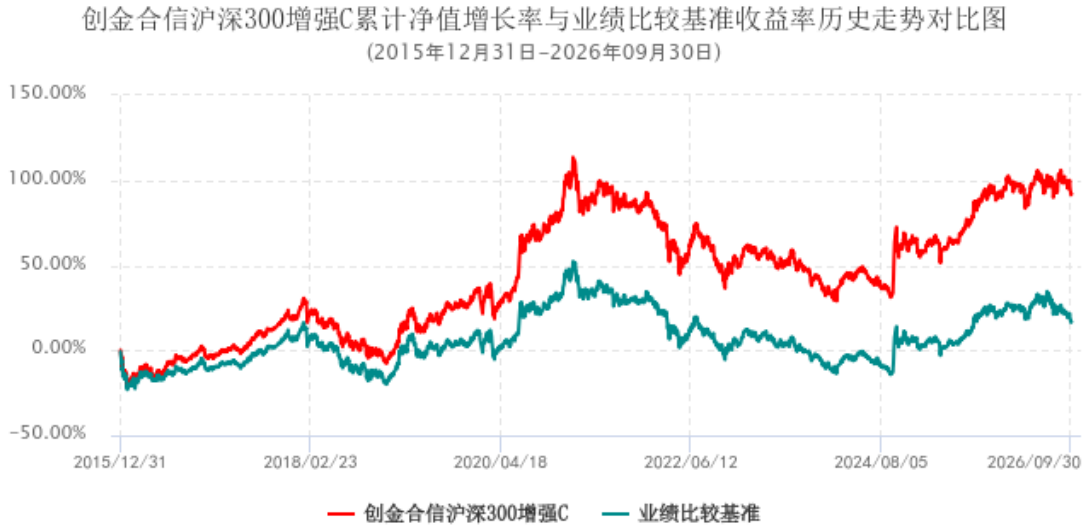
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.88%	1.20%	-11.86%	1.22%	6.98%	-0.02%
过去六个月	3.16%	1.14%	-1.89%	1.22%	5.05%	-0.08%
过去一年	-0.16%	1.02%	-5.66%	1.08%	5.50%	-0.06%
过去三年	30.62%	1.05%	17.66%	1.09%	12.96%	-0.04%
过去五年	4.00%	1.05%	-9.29%	1.07%	13.29%	-0.02%
过去七年	56.35%	1.12%	14.73%	1.12%	41.62%	0.00%
过去十年	103.96%	1.09%	34.05%	1.10%	69.91%	-0.01%
自基金合同生效起至今	92.09%	1.13%	16.87%	1.13%	75.22%	0.00%

创金合信沪深 300 增强 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	-4.90%	1.20%	-11.86%	1.22%	6.96%	-0.02%
过去六个月	3.12%	1.14%	-1.89%	1.22%	5.01%	-0.08%
过去一年	-0.25%	1.02%	-5.66%	1.08%	5.41%	-0.06%
过去三年	30.24%	1.05%	17.66%	1.09%	12.58%	-0.04%
过去五年	3.49%	1.05%	-9.29%	1.07%	12.78%	-0.02%
过去七年	55.17%	1.12%	14.73%	1.12%	40.44%	0.00%
过去十年	104.10%	1.09%	34.05%	1.10%	70.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	92.08%	1.13%	16.87%	1.13%	75.21%	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		
孙悦	本基金基金经理	2021 年 7 月 19 日	-	9	孙悦先生，中国国籍，北京大学硕士。2017 年 7 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、兼任投资经理。
董梁	本基金基金经	2018 年 11 月 19 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

	理、首席量化投资官、量化指数部负责人				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，宏观交易主线从政策分化转向利率冲击与产业景气的拉锯。美国方面，通胀粘性持续，美联储 9 月加息 25 个基点，市场对年内进一步加息的预期升温。中东局势再度升级，霍尔木兹海峡通行量明显回落，能源价格大幅上涨，全球通胀预期再获支撑。国内方面，三季度经济呈“工业生产和出口较强、消费偏弱、投资承压”的分化格局，但政策端明显加力，国常会明确加大逆周期调节力度，专项债发行提速，新质生产力相关领域投资保持高增，市场对后续增量政策仍有期待。大类资产方面，原油大涨，黄金反弹后回落，美元指数上涨，美股小幅上涨。国内市场方面，主要指数普遍下跌，科技板块调整幅度较大，资金从高位方向撤出，银行、红利等低位板块逆势走强，风格切换特征鲜明。

本基金以沪深 300 指数为基准，2026 年三季度，沪深 300 指数下跌，指数成分股内，行业表现分化较大，相对表现较好的行业是采掘、房地产、银行，表现较差的是电子、通信、电气设备。风格方面，成分股内价值因子表现较好，beta 因子表现较差。

在产品管理过程中，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资。采用经典的多因子模型对个股进行收益预测，采用风险模型严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制投资组合相对基准指数的跟踪误差，在此基础上追求高胜率、可持续的超额收益。在投资过程中，持续对多因子模型进行改进，加入新因子、采用新算法、不断提高模型的预测能力，同时叠加行业轮动策略、短周期交易策略，力争增厚投资组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.6986 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.88%，同期业绩比较基准收益率为-11.86%；截至本报告期末创金合信沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.6886 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.90%，同期业绩比较基准收益率为-11.86%。

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	230,699,989.76	89.31
	其中：股票	230,699,989.76	89.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,011,675.12	5.04
	其中：债券	13,011,675.12	5.04
	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	13,887,159.60	5.38
8	其他资产	715,034.81	0.28
9	合计	258,313,859.29	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

金额单位：人民币元

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	11,151,986.30	4.48
C	制造业	108,380,663.57	43.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,021,342.00	1.62
E	建筑业	2,501,619.25	1.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,787,096.00	3.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,728,990.82	6.33
J	金融业	53,181,823.37	21.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,939,000.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	7,396,428.00	2.97
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	212,088,949.31	85.29

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

金额单位：人民币元

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	38,185.32	0.02
C	制造业	16,822,069.88	6.76
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	7,131.59	0.00
J	金融业	441,535.00	0.18
K	房地产业	55,993.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	478,335.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	767,790.66	0.31
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	18,611,040.45	7.48

5.2.3 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 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	300308	中际旭创	14,200	11,479,848.00	4.62
2	300750	宁德时代	36,202	10,538,764.22	4.24
3	600519	贵州茅台	7,457	9,385,529.34	3.77
4	603259	药明康德	44,200	7,396,428.00	2.97
5	688256	寒武纪	6,282	6,338,600.82	2.55
6	601398	工商银行	726,200	6,012,936.00	2.42

7	603986	兆易创新	15,200	5,379,280.00	2.16
8	600030	中信证券	173,676	4,491,261.36	1.81
9	000001	平安银行	386,500	4,471,805.00	1.80
10	601988	中国银行	657,800	4,426,994.00	1.78

5.3.2 报告期末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	600733	北汽蓝谷	744,100	3,772,587.00	1.52
2	688249	晶合集成	65,729	2,156,568.49	0.87
3	688629	华丰科技	16,786	1,701,261.10	0.68
4	688825	长鑫科技	32,477	1,255,236.05	0.50
5	688331	荣昌生物	9,086	1,066,151.24	0.43

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	13,011,675.12	5.23
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	13,011,675.12	5.23

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019827	26 国债 01	129,000	13,011,675.12	5.23

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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
IF2612	IF2612	1	1,289,820.00	-60,519.92	-
公允价值变动总额合计（元）					-60,519.92
股指期货投资本期收益（元）					-538,604.27
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-91,989.92

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

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；平安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	272,296.09
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	442,738.56
6	其他应收款	0.16
7	其他	-
8	合计	715,034.81

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 报告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的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	1,255,236.05	0.50	网下新股限售

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	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	61,658,885.35	69,611,013.25

报告期期间基金总申购份额	1,616,969.18	70,401,690.85
减：报告期期间基金总赎回份额	5,933,592.27	50,430,017.69
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	57,342,262.26	89,582,686.41

§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	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	2,914,868.80	-
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	2,914,868.80	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.08	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	2,914,868.80	1.98	-	-	-
基金管理人高级管理人员	436.31	0.00	-	-	-
基金经理等人员	256,838.55	0.17	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	3,172,143.66	2.16	0.00	0.00	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20260715 - 20260715	0.00	44,534,842.93	30,603,469.88	13,931,373.05	9.48%
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。							

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；

3、创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年 3 季度报告原文。

10.2 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

10.3 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