

创金合信益久 9 个月持有期债券型证 券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 03 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 4 月 20 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的法律责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 16 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 创金合信益久 9 个月持有期债券 |
| 基金主代码 | 018506 |
| 交易代码 | 018506 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 6 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 201,543,973.94 份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资组合风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金综合考虑宏观经济、政策及产业趋势、市场利率、流动性水平及资产估值等因素，以定性与定量分析相结合的方式，合理评估债券、股票和现金等资产的投资价值及风险收益特征，在对整体风险水平进行有效控制的基础上，制定本基金的资产配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）久期配置策略</p> <p>根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估，考虑在运作周期中所处阶段，确定债券组合的久期配置。本基金将在预期市场利率下行时，适当拉长债券组合的久期水平，在预期市场利率上行时，适当缩短债券组合的久期水平，以此提高债券组合的收益水平。</p> <p>（2）期限结构配置策略</p> <p>在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限</p> |

结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类别配置策略

主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

（4）信用类债券投资策略

对于信用类债券（含资产支持证券，下同），基金管理人将利用行业和公司的信用研究力量，对所投资的信用品种进行详细的分析及风险评估，依据不同信用债发行主体所处行业未来发展前景以及自身在行业内的竞争能力，对不同发行主体的债券进行内部评级分类。在实际投资中，投资人员还将结合个券流动性、到期收益率、税收因素、市场偏好等多方面因素进行个券选择，以平衡信用债投资的风险与收益。

本基金所投资的信用债的信用评级在 AA 及以上（有债项评级的以债项评级为准，无债项评级的以主体评级为准，短期融资券、超短期融资券参照主体评级），其中本基金投资于信用评级为 AA 的信用债占信用债资产的比例为 0-20%，投资于信用评级为 AA+ 的信用债占信用债资产的比例为 0-50%，投资于信用评级为 AAA 的信用债占信用债资产的比例为 50%-100%。上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，评级机构以基金管理人选定为准。基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内调整至符合约定。

（5）跨市场套利策略

跨市场套利是根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券组合，提高投资收益，实现跨市场套利。

（6）回购放大策略

本基金可采用回购放大策略扩大收益，即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益。

（7）可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其标的股权的价值、债券价值和内嵌期权的价值，本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金也可根据新发可转换债券和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，参与可转换债券和可交换债券的新券

| | | | |
|-----------------|---|--------------------|--------------------|
| | <p>申购。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) A 股投资策略</p> <p>(2) 港股通标的股票投资策略</p> <p>(3) 存托凭证的投资策略</p> <p>4、国债期货交易策略</p> <p>5、基金投资策略</p> <p>本基金只投资于可上市交易的股票型 ETF 与本基金管理人管理的权益类证券投资基金，并在定期报告中予以披露。本基金投资的权益类证券投资基金包括股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：(1)基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；(2)基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。</p> <p>本基金通过定量分析与定性分析相结合的方式，对基金公司及其基金做出综合性评价。对基金公司的评价主要考虑平均业绩、管理基金的总规模及增速、投研团队配置与离职率、风控制度与落实情况、公司受到的奖惩情况等维度；对基金的评价主要考虑历史业绩、风险指标、收益稳定性等，各类型采用不同的评价体系。</p> <p>6、信用衍生品投资策略</p> | | |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数收益率*2% | | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> | | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信益久 9 个月持有期债券 A | 创金合信益久 9 个月持有期债券 C | 创金合信益久 9 个月持有期债券 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 018506 | 018507 | 018508 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 72,789,587.11 份 | 29,380,480.45 份 | 99,373,906.38 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 1 月 1 日—2026 年 3 月 31 日) | | |
|-----------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | 创金合信益久 9 个月持有期债券 A | 创金合信益久 9 个月持有期债券 C | 创金合信益久 9 个月持有期债券 E |
| 1.本期已实现收益 | 113,726.03 | 66,105.32 | 222,018.48 |

| | | | |
|--------------------|---------------|---------------|----------------|
| 2.本期利润 | -137,147.25 | -97,727.73 | -219,531.96 |
| 3.加权平均基金份额 本期利润 | -0.0018 | -0.0028 | -0.0019 |
| 4.期末基金资产净值 | 81,117,780.26 | 32,423,428.79 | 110,116,119.54 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1144 | 1.1036 | 1.1081 |

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

创金合信益久9个月持有期债券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 | -0.19% | 0.17% | 0.32% | 0.10% | -0.51% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.33% | 0.14% | 0.67% | 0.10% | -0.34% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.50% | 0.11% | 3.22% | 0.10% | -0.72% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 11.44% | 0.18% | 12.52% | 0.11% | -1.08% | 0.07% |

创金合信益久9个月持有期债券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 | -0.27% | 0.17% | 0.32% | 0.10% | -0.59% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.16% | 0.14% | 0.67% | 0.10% | -0.51% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.15% | 0.11% | 3.22% | 0.10% | -1.07% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 10.36% | 0.18% | 12.52% | 0.11% | -2.16% | 0.07% |

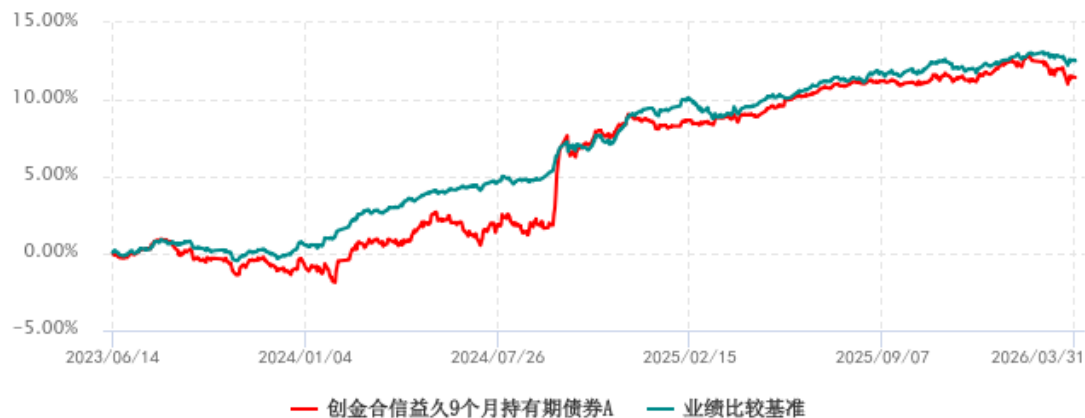
创金合信益久9个月持有期债券E

| 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 | -0.30% | 0.17% | 0.32% | 0.10% | -0.62% | 0.07% |
| 过去六个月 | 0.11% | 0.14% | 0.67% | 0.10% | -0.56% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.04% | 0.11% | 3.22% | 0.10% | -1.18% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 10.81% | 0.18% | 12.52% | 0.11% | -1.71% | 0.07% |

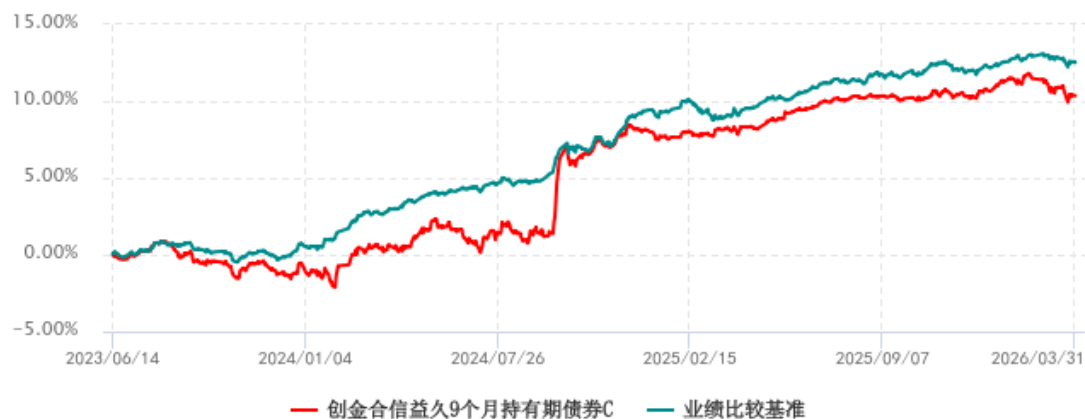
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收

益率变动的比较

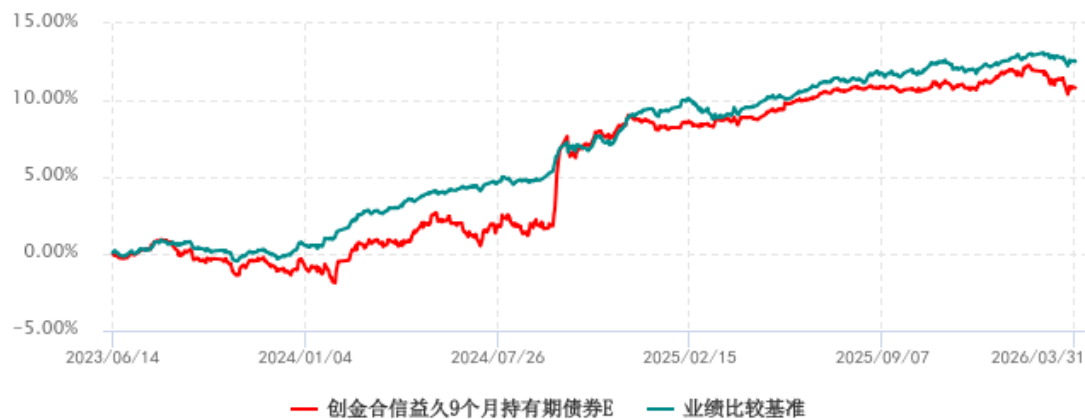
创金合信益久9个月持有期债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年06月14日-2026年03月31日)



创金合信益久9个月持有期债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年06月14日-2026年03月31日)



创金合信益久9个月持有期债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年06月14日-2026年03月31日)



§ 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 | | |
| 黄佳祥 | 本基金基金经理 | 2024年4月10日 | - | 8 | 黄佳祥先生，中国国籍，厦门大学博士。2017年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，现任基金经理。 |
| 黄弢 | 本基金基金经理、总经理助理、权益投研总部、均衡积极收益投资部、多策略积极绝对收益投资部负责人 | 2023年6月14日 | - | 23 | 黄弢先生，中国国籍，清华大学硕士。2002年7月加入长城基金管理有限公司，任市场部渠道主管，2005年11月加入海富通基金管理有限公司，任市场部南方区总经理，2008年2月加入深圳市鼎诺投资管理有限公司，任公司执行总裁，2017年5月加入北京和聚投资管理有限公司，任首席策略师，2018年4月加入上海禾驹投资管理中心（有限合伙），任首席策略师，2020年2月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部负责人，现任总经理助理，兼任权益投研总部、均衡积极收益投资和多策略积极绝对收益投资部负责人、基金经理、投资经理。 |
| 谢创 | 本基金基金经理、固收投资部负责人 | 2023年6月14日 | - | 10 | 谢创先生，中国国籍，西南财经大学硕士。2015年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任交易部交易员、固定收益部基金经理助理，固定收益部总监助理，现任固收投资部负责人、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|---------|---------|------------------|------------|
| 黄弢 | 公募基金 | 5 | 2,159,496,926.11 | 2020-05-08 |
| | 私募资产管理计 | 2 | 6,249,160.96 | 2025-06-06 |

| | | | | |
|--|------|---|------------------|---|
| | 划 | | | |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 7 | 2,165,746,087.07 | - |

本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，黄弢离任产品情况如下：

产品类型：私募资产管理计划，离任数量：2 只，离任时间：2026-01-27、2026-02-02。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

一季度权益市场大幅波动，1-2 月基本维持了传统春季躁动的走势，各种主题和热点不断，其中以科技板块和资源板块表现最为突出，3 月因中东地区冲突的原因大幅调整，各行业板块和风格板块都遭遇重大回撤。基金在一季度的操作中维持了对市场中长期走慢牛和长牛的基本判断，总体仓位保持在相对较高的位置，并在外部冲突加剧，市场大幅回撤的过程中逆势加仓，目前已加至产品仓位上限，持仓结构中仍然以大消费为代表的内需板块（包括食品饮料、社服、农林牧渔、汽车等）为主，占权益仓位的 40%左右，另有 TMT、医疗保健、中游制造、金融地产和顺周期各占 10%左右，对于二季度维持乐观观点，目前核心节点还是地区冲突，尽管中东冲突解决的路径和时间表很难做精确判断，但现实是冲突的加剧对各方而言都是弊大于利，基于各种因素的约束来倒逼结束冲突成为一个相对更

大概率的选择，而只要冲突结束，市场的风险偏好将得以修复，市场又能回到原有的上行趋势中。

债市方面，2026 年一季度经济“开门红”略低于预期，市场前期对地方债供需结构的担忧边际缓解，流动性充裕，在配置盘和资金驱动下，债市表现超预期，信用利差压缩且维持低位运行，中短端信用债交易拥挤度提升。2025 年 12 月中旬，市场对长端地方债和超长债供需担忧，叠加权益市场风险偏好维持高位，长端利率持续调整，10 年国债上行至 2026 年一季度高点 1.90% 附近。随后监管对股市降温，央行结构性降息落地，银行存款和保险分红险开门红超预期，信贷开门红低于预期，配置盘持续增配长端利率债，春节前央行持续投放长期流动性，虽然降息和降准预期延后，但机构持券过节意愿较强，期间 10 年国债下行 12BP，期限利差和信用利差压缩，流动性宽裕，广义资管配置中短端。

春节后至 3 月中上旬两会期间，市场开始关注两会政策，尤其是地方债供给和全年经济增长目标，美国最高法院判定特朗普部分关税政策违法，同时假期高频经济数据表现较好，上海“沪七条”地产政策优化落地，政府工作报告各项经济目标基本符合预期，未有趋势行情。

3 月中上旬开始，市场主线从两会开始切换至美伊冲突，长端资产和中短端分化。2 月 28 日，美以联合对伊朗发动军事打击，地缘态势快速升级，布伦特原油期货价格中枢从 60-70 美元提升至 100-110 美元，海外资产遭遇流动性冲击，国内债市主线切换至通胀担忧，PPI 同比转正从 2026 年 Q2 中后期前置到 3 月份，同时担忧后续超长债供给节奏，两会期间央行表态偏谨慎，短期降准降息概率不高，同时 1-2 月经济开门红强度不弱，期限利差走阔，输入型通胀不改货币政策立场，机构继续抱团中短端，交易拥挤度进一步提升。3 月中下旬，美伊谈判信号初现，但从双方表态仍存在较大分歧，市场开始关注原油价格中枢上涨和供应链断裂对经济的负面影响，理财 4 月抢跑，收益率小幅下行。

展望后市，输入性通货膨胀难改货币政策立场，中短端信用利差维持低位运行，当前流动性溢价对中低等级信用债整体风险补偿较弱，组合整体保持中性久期，关注高等级信用债和利率债，把握品种之间的结构性行情以及债市阶段性超调修复的机会。组合将结合当前及未来宏观政策形势变化的判断，控制信用风险暴露情况，控制组合杠杆总体水平，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信益久 9 个月持有期债券 A 基金份额净值为 1.1144 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%；截至本报告期末创金合信益久 9 个月持有期债券 C 基金份额净值为 1.1036 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%；截至本报告期末创金合信

益久9个月持有期债券E基金份额净值为1.1081元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为0.32%。

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出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 19,251,906.31 | 7.18 |
| | 其中：股票 | 19,251,906.31 | 7.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 233,940,603.49 | 87.19 |
| | 其中：债券 | 233,940,603.49 | 87.19 |
| | 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 | 15,063,117.70 | 5.61 |
| 8 | 其他资产 | 42,173.33 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 268,297,800.83 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,834,594.42元，占净值比为1.27%。

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 | 233,450.00 | 0.10 |
| C | 制造业 | 8,196,194.89 | 3.66 |
| 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 | 343,143.00 | 0.15 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,389,765.00 | 0.62 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,713,712.00 | 0.77 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 313,120.00 | 0.14 |
| J | 金融业 | 2,040,013.00 | 0.91 |
| K | 房地产业 | 967,991.00 | 0.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,219,923.00 | 0.55 |
| 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 | 16,417,311.89 | 7.34 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 1,533,481.07 | 0.69 |
| 工业 | 472,950.40 | 0.21 |
| 信息技术 | 828,162.95 | 0.37 |
| 合计 | 2,834,594.42 | 1.27 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 600258 | 首旅酒店 | 114,400 | 1,713,712.00 | 0.77 |
| 2 | 002352 | 顺丰控股 | 23,000 | 874,920.00 | 0.39 |
| 2 | H06936 | 顺丰控股 | 15,200 | 472,950.40 | 0.21 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 24,100 | 1,187,166.00 | 0.53 |
| 4 | 001979 | 招商蛇口 | 115,100 | 967,991.00 | 0.43 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 25,100 | 930,959.00 | 0.42 |
| 6 | H09988 | 阿里巴巴—W | 8,600 | 903,611.03 | 0.40 |
| 7 | H00981 | 中芯国际 | 18,500 | 828,162.95 | 0.37 |
| 8 | 601211 | 国泰海通 | 47,000 | 779,730.00 | 0.35 |
| 9 | 002572 | 索菲亚 | 60,000 | 760,200.00 | 0.34 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 97,700 | 639,935.00 | 0.29 |

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 | 4,053,098.08 | 1.81 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 170,493,649.46 | 76.23 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,318,123.28 | 18.03 |
| 4 | 企业债券 | 36,104,667.73 | 16.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 23,289,188.22 | 10.41 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 233,940,603.49 | 104.60 |

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 | 232580012 | 25 中行二级资本债 01BC | 200,000 | 20,336,268.49 | 9.09 |
| 2 | 524440 | 25 申证 08 | 200,000 | 20,243,265.75 | 9.05 |
| 3 | 250203 | 25 国开 03 | 200,000 | 19,805,150.68 | 8.86 |
| 4 | 2380195 | 23 松滋金投债 | 100,000 | 11,330,849.32 | 5.07 |
| 5 | 2128026 | 21 建设银行二级 02 | 100,000 | 11,133,893.15 | 4.98 |

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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，成都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四川监管局处罚的情况；国家开发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、中国人民银行处罚的情况；中国建设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、中国人民银行处罚的情况；中国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

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规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 | 41,936.60 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 236.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 42,173.33 |

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信益久 9 个月持有期债券 A | 创金合信益久 9 个月持有期债券 C | 创金合信益久 9 个月持有期债券 E |
|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 76,885,686.67 | 35,939,104.76 | 131,308,936.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 442,966.83 | 39,310.20 | 870,318.48 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,539,066.39 | 6,597,934.51 | 32,805,348.33 |
| 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 | 72,789,587.11 | 29,380,480.45 | 99,373,906.38 |

§ 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 | 20260225 - 20260331 | 45,280,746.24 | 0.00 | 0.00 | 45,280,746.24 | 22.47% |

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、《创金合信益久 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信益久 9 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信益久 9 个月持有期债券型证券投资基金 2026 年 1 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梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2026 年 4 月 20 日