

创金合信弘达债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 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：苏州银行股份有限公司

送出日期：2026 年 7 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责任。

基金托管人苏州银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信弘达债券
基金主代码	026676
交易代码	026676
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 3 月 27 日
报告期末基金份额总额	122,000,705.62 份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 （1）利率预期策略、（2）期限结构配置策略、（3）债券类别配置策略、（4）信用类债券投资策略、（5）回购放大策略、（6）可转换债券和可交换债券投资策略 3、股票投资策略 4、国债期货投资策略 5、信用衍生品投资策略 6、基金投资策略
业绩比较基准	中债-新综合财富(总值)指数收益率*89%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*1%
风险收益特征	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。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。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信弘达债券 A	创金合信弘达债券 C
下属分级基金的交易代码	026676	026677
报告期末下属分级基金的份额总额	122,000,695.62 份	10.00 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 4 月 1 日—2026 年 6 月 30 日）	
	创金合信弘达债券 A	创金合信弘达债券 C
1.本期已实现收益	1,133,486.40	0.10
2.本期利润	387,313.38	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0038	-
4.期末基金资产净值	121,941,306.56	9.98
5.期末基金份额净值	0.9995	0.9980

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

创金合信弘达债券 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	-0.04%	0.28%	2.15%	0.14%	-2.19%	0.14%
自基金合同 生效起至今	-0.05%	0.28%	2.17%	0.14%	-2.22%	0.14%

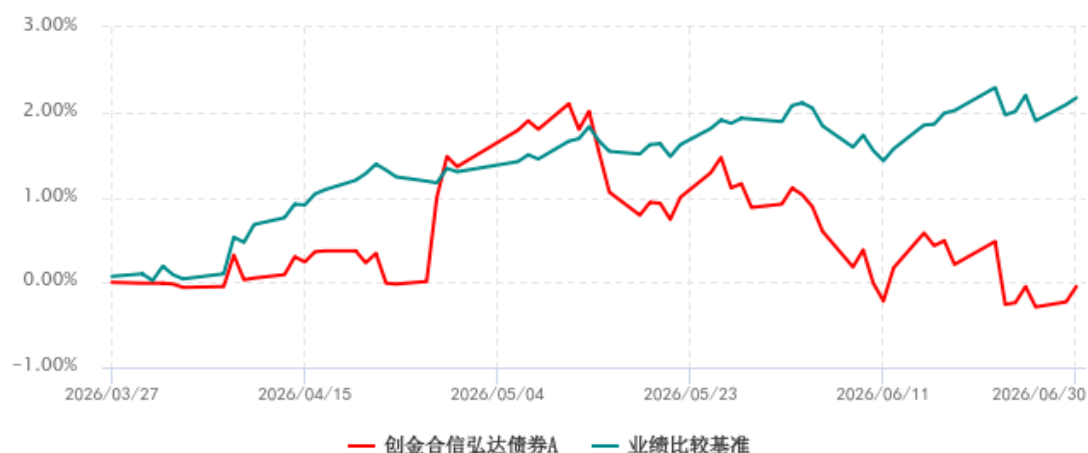
创金合信弘达债券 C

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
----	------------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

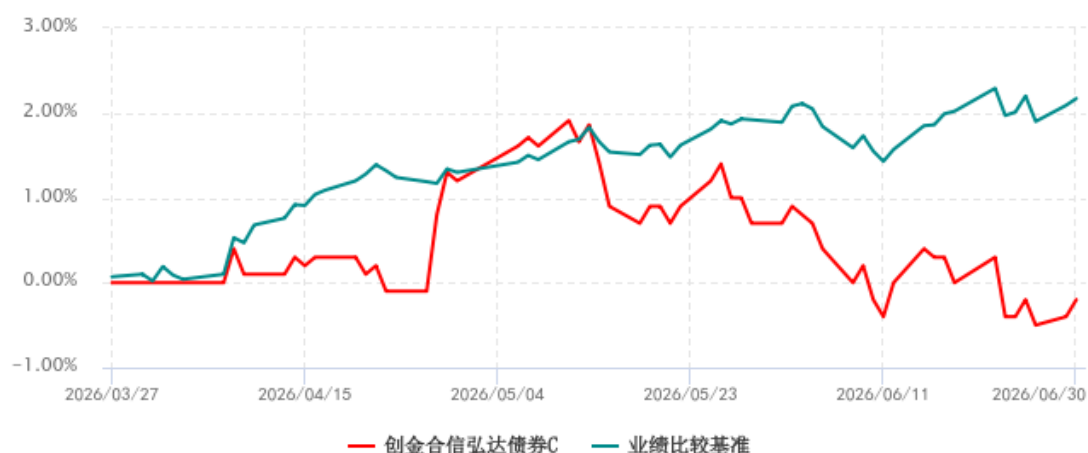
过去三个月	-0.20%	0.28%	2.15%	0.14%	-2.35%	0.14%
自基金合同生效起至今	-0.20%	0.27%	2.17%	0.14%	-2.37%	0.13%

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

创金合信弘达债券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
(2026年03月27日-2026年06月30日)



创金合信弘达债券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
(2026年03月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2026 年 3 月 27 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§ 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		
刘润哲	本基金基金经理、稳健收益投资部负责人、多资产投资管理部执行总监	2026 年 4 月 7 日	-	14	刘润哲先生，中国国籍，康涅迪格大学硕士。2011 年 9 月加入美林银行（Merrill Lynch），任投资顾问，2012 年 9 月加入中国人寿保险股份有限公司，任精算部主管，2016 年 1 月加入中国民生银行股份有限公司，任资产管理部投资经理，2022 年 5 月加入创金合信基金管理有限公司，现任稳健收益投资部负责人、兼任多资产投资管理部执行总监、基金经理。
谢创	本基金基金经理、固收投资部负责人	2026 年 4 月 4 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。
黄佳祥	本基金基金经理	2026 年 3 月 27 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。
谢鑫	本基金基金经理、固收策略与指数投资部负责人	2026 年 3 月 27 日	-	14	谢鑫先生，中国国籍，中国科学院研究生院硕士，2011 年 7 月加入中国国际期货股份有限公司，任研究院研究员，2012 年 9 月加入北京光合大有投资管理有限公司，任投资部投资经理，2015 年 4 月加入光大期货有限公司，任互联网金融部投资经理，2017 年 6 月加入中国邮政储蓄银行股份有限公司，任资产管理部资产组合处投资经理，2020 年 4 月加入中邮理财有限责任公司，历任组合策略部投资经理、组合策略部副总经理，2024 年 4 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固收混合资产投资部负责人，现任固收策略与指数投资部负责人、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。

4.2 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

二季度国内市场延续 K 型分化，海外由于美伊冲突等重要宏观扰动影响，大宗商品价格出现显著波动，同步资本市场定价也相应出现显著波动，科技板块伴随短期基本面确定性向上的驱动下独立走强，同时对其他板块形成资金虹吸效应，整体万得全 A 等权指数小幅下跌。最近一段时间市场相对重要的变化，一个是宏观风险因子的边际缓释，资产定价重新回到产业和基本面逻辑，伴随美伊协议达成，原油为主的大宗商品价格快速回落，后续商品价格波动率有望明显下降。对应到顺周期资产，分子端波动率降低，有助于市场相关方向的盈利预期逐步企稳。二是科技板块在强势的基本面趋势下对其他板块的形成资金虹吸加剧，后续看，市场在高位科技资产的资金分歧扰动结束后，将回归产业自身交易逻辑，价值类资产在持续资金流出后配置性价比进一步提升，两端资产的风险都会有一定缓释，我们对后续市场判断整体乐观。

展望后市，货币政策维持偏宽松的状态，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，关注 7 月政治局会议的定调，组合主要配置高等级信用债和利率债，把握品种之间的结构性行情。

从组合角度看，不做方向上的大幅行业轮动，组合以定价合理性为出发点进行配置优化，成长板块重点关注业绩兑现度高和远期成长空间置信度逐步提升的板块，同时随着美联储政策逐步回归相机抉择、地缘风险边际缓和，低估值板块有望迎来修复，产品在传统制造业、化工、有色、航空、农业、环保等价值板块进行均衡配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信弘达债券 A 基金份额净值为 0.9995 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准收益率为 2.15%；截至本报告期末创金合信弘达债券 C 基金份额净值为 0.9980 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为 2.15%。

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	9,963,133.56	7.97
	其中：股票	9,963,133.56	7.97
2	基金投资	2,628,547.30	2.10
3	固定收益投资	94,843,573.67	75.84
	其中：债券	94,843,573.67	75.84
	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	8,000,368.22	6.40
	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	1,170,378.11	0.94
8	其他资产	8,455,813.49	6.76
9	合计	125,061,814.35	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 206,497.76 元，占净值比为 0.17%。

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	1,522,431.00	1.25
C	制造业	6,752,397.80	5.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,561.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	660,809.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	383,812.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	14,352.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	406,273.00	0.33
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	9,756,635.80	8.00

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（%）
信息技术	206,497.76	0.17
合计	206,497.76	0.17

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	300037	新宙邦	11,300	1,049,205.00	0.86
2	600547	山东黄金	40,200	928,218.00	0.76
3	600160	巨化股份	15,700	832,257.00	0.68
4	600885	宏发股份	21,900	755,331.00	0.62
5	601111	中国国航	102,700	621,335.00	0.51
6	301392	汇成真空	1,800	519,552.00	0.43
7	600323	瀚蓝环境	14,400	395,424.00	0.32

8	300138	晨光生物	42,800	385,200.00	0.32
9	002027	分众传媒	79,300	383,812.00	0.31
10	002106	莱宝高科	21,000	367,920.00	0.30

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	88,737,088.30	72.77
	其中：政策性金融债	14,269,362.47	11.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	6,106,485.37	5.01
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	94,843,573.67	77.78

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	232380066	23 中行二级资本债 03A	100,000	10,649,696.99	8.73
2	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	100,000	10,547,640.55	8.65
3	232480004	24 农行二级资本债 01A	100,000	10,398,715.07	8.53
4	092280139	22 交行二级资本债 02A	100,000	10,391,416.99	8.52
5	138664	22 中金 G1	100,000	10,081,046.58	8.27

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局处罚的情况；交通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；上海浦东发展银行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、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局上海市分局处罚的情况；中国农业发展银行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；中国农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；中国邮政集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到大兴安岭地区邮政管理局、岳阳市邮政管理局、天津市邮政管理局第一分局、天津市邮政管理局、青岛市市北区综合行政执法局处罚的情况；中信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云南监管局、国家金融监督管理总局、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

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	8,455,813.49
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	其他	-
8	合计	8,455,813.49

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 （份）	公允价值 （元）	占基金资 产净值比 例（%）	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	515880	国泰中证全指通信设备 ETF	契约型开放式	362,800.00	651,588.80	0.53	否

2	159994	5GETF	契约型开放式	350,200.00	598,141.60	0.49	否
3	159566	易方达国证新能源电池 ETF	契约型开放式	211,200.00	479,212.80	0.39	否
4	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	契约型开放式	40,600.00	203,771.40	0.17	否
5	159381	华夏创业板人工智能 ETF	契约型开放式	121,100.00	178,017.00	0.15	否
6	159995	华夏国证半导体芯片 ETF	契约型开放式	35,400.00	120,006.00	0.10	否
7	159748	富国中证沪港深创新药产业 ETF	契约型开放式	163,000.00	117,523.00	0.10	否
8	561100	富国中证消费电子主题 ETF	契约型开放式	47,200.00	105,869.60	0.09	否
9	512890	红利低波	契约型开放式	89,700.00	95,709.90	0.08	否
10	561330	国泰中证有色金属矿业主题 ETF	契约型开放式	83,200.00	78,707.20	0.06	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026-04-01 至 2026-06-30	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,502.12	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	331.75	-
当期交易基金产生的交易费	921.87	-

(元)		
-----	--	--

注：1. 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取，并记入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

2. 当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信弘达债券 A	创金合信弘达债券 C
报告期期初基金份额总额	203,022,553.88	10.00
报告期期间基金总申购份额	71,980,189.71	9.88
减：报告期期间基金总赎回份额	153,002,047.97	9.88
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	122,000,695.62	10.00

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§ 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	20260401 - 20260630	50,003,333.33	0.00	0.00	50,003,333.33	40.99%
机构	2	20260428 - 20260510	19,999,666.66	0.00	19,999,666.66	0.00	0.00%
机构	3	20260626 - 20260630	14,999,000.00	40,019,909.95	14,999,000.00	40,019,909.95	32.80%
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、《创金合信弘达债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信弘达债券型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信弘达债券型证券投资基金 2026 年 2 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梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2026 年 7 月 20 日