金信转型创新成长灵活配置混合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:金信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 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26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07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金信转型创新混合
基金主代码	002810
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 06 月 08 日
报告期末基金份额总额	119,066,188.60 份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，挖掘受益于中国经济转型与创新过程中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下五个方面： 1、大类资产配置策略 本基金将通过跟踪考量宏观经济指标以及各项国家政策来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金资产将主要投资于转型创新主题的证券，基于受益于经济转型及创新的行业，同时会随着经济社会的不断发展，动态调整转型创新受益行业的范围。在操作过程中，本基金将根据宏观经济中期趋势、政策环境变化、各行业景气度情况以及估值区间水平等因素，对行业配置不断进行调整和优化。 3、债券投资策略 在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固

	定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，以获取稳健的投资收益。 4、资产支持证券投资策略 本基金管理人通过考量宏观经济形势、资产池结构等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 5、衍生品投资策略 1)股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。 2)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×85%+中证综合债指数（全价）收益率×10%+人民币活期存款基准利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。	
基金管理人	金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	金信转型创新混合 A	金信转型创新混合 C
下属分级基金的交易代码	002810	020384
报告期末下属分级基金的份额总额	25,489,072.79 份	93,577,115.81 份

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中证 800 指数收益率×65%＋中证综合债指数收益率×35%”调整为“中证 800 指数收益率×85%+中证综合债指数（全价）收益率×10%+人民币活期存款基准利率（税后）×5%”。

§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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	金信转型创新混合 A	金信转型创新混合 C
1.本期已实现收益	3,012,444.70	5,647,761.68
2.本期利润	-11,083,541.04	-23,877,779.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4338	-0.2769
4.期末基金资产净值	101,192,931.59	239,869,658.54
5.期末基金份额净值	3.9701	2.5633

注：1、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。

2、本报告所列示的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。

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

金信转型创新混合 A 净值表现

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	-9.89%	1.89%	-9.56%	0.96%	-0.33%	0.93%
过去六个月	9.50%	1.84%	-1.15%	0.93%	10.65%	0.91%
过去一年	17.54%	1.94%	-2.00%	0.82%	19.54%	1.12%
过去三年	118.14%	1.93%	19.17%	0.80%	98.97%	1.13%
过去五年	112.65%	1.82%	3.89%	0.75%	108.76%	1.07%
过去七年	340.63%	1.70%	28.66%	0.78%	311.97%	0.92%
过去十年	280.64%	1.53%	39.26%	0.76%	241.38%	0.77%
自基金合同生效起至今	297.01%	1.51%	43.40%	0.76%	253.61%	0.75%

金信转型创新混合 C 净值表现

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	-10.03%	1.89%	-9.56%	0.96%	-0.47%	0.93%
过去六个月	9.17%	1.84%	-1.15%	0.93%	10.32%	0.91%
过去一年	16.63%	1.94%	-2.00%	0.82%	18.63%	1.12%
自基金合同生效起至今	108.79%	1.99%	26.86%	0.81%	81.93%	1.18%

注：根据《金信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中证 800 指数收益率×65%＋中证综合债指数收益率×35%”调整为“中证 800 指数收益率×85%+中证综合债指数（全价）收益率×10%+人民币活期存款基准利率（税后）×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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





注：根据《金信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中证 800 指数收益率×65%＋中证综合债指数收益率×35%”调整为“中证 800 指数收益率×85%+中证综合债指数（全价）收益率×10%+人民币活期存款基准利率（税后）×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3.3 其他指标

无。

§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		
杨超	投资部执行董事兼基金经理、研究总监	2022-01-19	-	20 年	南开大学博士。曾任鹏华基金化工行业研究员，高级研究员，长城证券化工行业资深研究员，首席研究员，研究所负责人。现任金信基金管理有限公司投资部执行董事兼基金经理、研究总监。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年 3 季度，组合重点配置方向与二季度相比变化不大，但个股持仓结构有所调整。一方面组合配置重点继续围绕军工及大飞机，燃气轮机，芯片，电子元器件，新材料等领域。另一方面，组合在军工领域，尤其是在两机，即飞机发动机和燃机方向，配置有所加强。从产业趋势的角度，AI 产业景气度继续向上游传导，从芯片扩散到被动元器件（包括电容、电感），芯片相关材料等。AI 的快速发展也增加了北美电力需求，燃气轮机相关产业景气度也较高。军工板块虽然目前仍然处于周期底部，但从中长期角度来看，部分领域估值性价比较高。并且 2026 年作为十五五开局之年，军工板块催化因素依然较多，尤其是大飞机、航空发动机、商业航天等方向，依然是非常值得关注的领域。此外，组合对新材料、红利、医药、化工等领域也保持密切关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金信转型创新混合 A 基金份额净值为 3.9701 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.89%，同期业绩比较基准收益率为-9.56%；截至报告期末金信转型创新混合 C 基金份额净值为 2.5633 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.03%，同期业绩比较基准收益率为-9.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现持有人数或基金资产净值预警的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	297,640,382.48	85.66
	其中：股票	297,640,382.48	85.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,100,641.22	2.62
	其中：债券	9,100,641.22	2.62
	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	36,243,202.59	10.43
8	其他资产	4,484,906.28	1.29

9	合计	347,469,132.57	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	-	-
C	制造业	275,156,054.56	80.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	940,800.00	0.28
F	批发和零售业	17,162,500.00	5.03
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	174,527.92	0.05
J	金融业	4,206,500.00	1.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	297,640,382.48	87.27

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	600391	航发科技	792,900	32,199,669.00	9.44
2	600893	航发动力	630,000	24,481,800.00	7.18
3	000768	中航西飞	810,000	18,727,200.00	5.49
4	001316	润贝航科	625,000	17,162,500.00	5.03
5	000738	航发控制	810,000	15,187,500.00	4.45
6	688510	航亚科技	580,000	13,630,000.00	4.00
7	600862	中航高科	730,000	13,030,500.00	3.82

8	688239	航宇科技	236,000	12,236,600.00	3.59
9	000534	万泽股份	560,000	12,112,800.00	3.55
10	603678	火炬电子	269,000	11,491,680.00	3.37

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	9,010,679.18	2.64
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）	89,962.04	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,100,641.22	2.67

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	019846	26 国债 14	90,000	9,010,679.18	2.64
2	110101	宝钛转债	670	89,962.04	0.03

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

根据基金合同约定，本基金投资范围未包含国债期货。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同约定，本基金投资范围未包含国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	169,201.73
2	应收证券清算款	2,180,745.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,134,958.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,484,906.28

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中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	金信转型创新混合 A	金信转型创新混合 C
报告期期初基金份额总额	26,162,155.88	108,390,613.62
报告期期间基金总申购份额	5,820,162.96	17,964,339.08
减：报告期期间基金总赎回份额	6,493,246.05	32,777,836.89
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	25,489,072.79	93,577,115.81

§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

基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立于 2016 年 6 月 8 日，截至本报告期末本基金已成立超过三年。

§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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或者超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

2、《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《金信转型创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

10.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室

深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

10.3 查阅方式

本基金管理人公司网站，网址：www.jxfunds.com.cn。

金信基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日