

创金合信稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 日

§1 重要提示.....	2
§2 基金产品概况.....	2
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	3
3.1 主要财务指标.....	3
3.2 基金净值表现.....	3
§4 管理人报告.....	4
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	4
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	5
4.3 公平交易专项说明.....	5
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析.....	6
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	6
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	6
§5 投资组合报告.....	7
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	7
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.....	8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	8
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.....	9
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.....	9
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.....	9
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.....	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	9
5.11 投资组合报告附注.....	10
§6 开放式基金份额变动.....	10
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
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.....	11
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
§9 备查文件目录.....	11
9.1 备查文件目录.....	11
9.2 存放地点.....	12
9.3 查阅方式.....	12

§ 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规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信稳健增利 6 个月持有期	
基金主代码	009268	
交易代码	009268	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 22 日	
报告期末基金份额总额	82,869,657.74 份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。	
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。	
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金与债券型基金，低于股票型基金。	
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	创金合信稳健增利 6 个月持有期 A	创金合信稳健增利 6 个月持有期 C
下属分级基金的交易代码	009268	009269
报告期末下属分级基金的份额总额	64,212,426.72 份	18,657,231.02 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（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	创金合信稳健增利6个月持有期A	创金合信稳健增利6个月持有期C
1.本期已实现收益	-127,122.66	-33,582.18
2.本期利润	-684,926.47	-204,488.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0091	-0.0121
4.期末基金资产净值	67,513,660.81	19,522,961.48
5.期末基金份额净值	1.0514	1.0464

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

创金合信稳健增利6个月持有期A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.91%	0.20%	-0.68%	0.25%	-0.23%	-0.05%
过去六个月	0.31%	0.16%	0.41%	0.22%	-0.10%	-0.06%
过去一年	5.33%	0.20%	3.20%	0.25%	2.13%	-0.05%
自基金合同生效起至今	5.14%	0.18%	2.10%	0.25%	3.04%	-0.07%

创金合信稳健增利6个月持有期C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.01%	0.20%	-0.68%	0.25%	-0.33%	-0.05%
过去六个月	0.11%	0.16%	0.41%	0.22%	-0.30%	-0.06%

过去一年	4.91%	0.19%	3.20%	0.25%	1.71%	-0.06%
自基金合同生效起至今	4.64%	0.18%	2.10%	0.25%	2.54%	-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



注：本基金建仓期为6个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	说明
----	----	-----------------	----------	----

		任职日期	离任日期	年限	
尹海影	本基金基金经理	2021年3月3日	-	9	尹海影先生，麻省理工大学金融学硕士，2011年6月加入美国摩根斯坦利有限责任公司，任固定收益部多资产交易员、分析师，2013年10月加入美国银行美林证券有限公司，任全球市场部量化交易经理，2015年2月加入美国道富基金管理有限公司，任量化与资产配置研究部助理副总经理、量化与资产配置分析师，2016年2月加入美国富达基金管理有限公司，任全球资产配置部分析师，核心投资团队成员，2017年3月加入广发基金管理有限公司资产配置部历任投资经理、总经理助理，2020年2月加入创金合信基金管理有限公司，任资产配置投资部副总监，兼任基金经理。
王一兵	本基金基金经理、固定收益部总监	2020年7月22日	-	17	王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。曾任职于四川和正期货公司，2009年3月加入第一创业证券股份有限公司，历任固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任固定收益部总监、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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

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

第三季度当中宏观经济的走势比预期略偏弱，流动性变化节奏比预期略偏慢偏宽松(包括一次降准的出现)。因此，产品在本季度的运作中以合理的平衡股债收益和权益资产的配置结构为主。在股债配置比例上以中等权益敞口进行配置，在通过久期的适当加长和信用收益的调整获得主要固收资产收益来源的基础上，进行权益资产的配置和选择，对组合进行风险的平衡和收益的增强。

展望后市，当前经济虽处于下行趋势，但幅度有限，市场也有一定预期，同时政策收紧节奏偏缓，流动性继续保持合理充裕。我们对权益市场持并不悲观的观点，认为没有系统性风险，将会有结构性配置的机会。综合当前的行业基本面和估值情况，我们认为当前市场较前期将表现的稍均衡一些，基本面改善和相对估值处于低位的板块具有好的配置价值。同时前期强势，基本面逻辑瑕疵最少的一些成长赛道仍存格局发展带来的增益空间。在未来一个季度的投资当中，会在紧密关注宏观环境变化，防范风险的前提下，在存有机会的方向上进行有利配置。固定收益市场在第二第三季度的机构资金配置和偏缓的流动性收紧节奏当中已经有了较优的收益表现，第四季度在经济与通胀的不定性当中，区间震荡的可能性较大。信用强势区域的信用债利差也出现了一定的反转缓和迹象。因此在固收资产的配置上在未来一个季度会以审慎的态度择优选券获取收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信稳健增利 6 个月持有期 A 基金份额净值为 1.0514 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.91%，同期业绩比较基准收益率为-0.68%；截至本报告期末创金合信稳健增利 6 个月持有期 C 基金份额净值为 1.0464 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.68%。

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	7,972,002.72	9.13
	其中：股票	7,972,002.72	9.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,502,508.50	78.48
	其中：债券	68,502,508.50	78.48
	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	7,200,000.00	8.25
	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	2,387,903.37	2.74
8	其他资产	1,227,570.29	1.41
9	合计	87,289,984.88	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

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	37,368.00	0.04
B	采矿业	93,837.00	0.11
C	制造业	6,201,381.77	7.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65.96	0.00
E	建筑业	152.50	0.00
F	批发和零售业	1,021.69	0.00
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	314,939.88	0.36
J	金融业	1,104,408.72	1.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	109,856.00	0.13

M	科学研究和技术服务业	95,821.00	0.11
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	4,432.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,718.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	7,972,002.72	9.16

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

金额单位：人民币元

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	300750	宁德时代	1,004	527,832.92	0.61
2	601012	隆基股份	5,878	484,817.44	0.56
3	000858	五粮液	2,100	460,719.00	0.53
4	600438	通威股份	8,200	417,708.00	0.48
5	600031	三一重工	16,400	417,216.00	0.48
6	600809	山西汾酒	1,140	359,670.00	0.41
7	300274	阳光电源	2,000	296,760.00	0.34
8	600036	招商银行	5,800	292,610.00	0.34
9	002812	恩捷股份	865	242,303.80	0.28
10	002142	宁波银行	6,400	224,960.00	0.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	6,505,850.00	7.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	25,624,200.00	29.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	35,039,300.00	40.26
7	可转债（可交换债）	1,333,158.50	1.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,502,508.50	78.71

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

金额单位：人民币元

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	101801142	18 泉州台商MTN003	80,000	8,570,400.00	9.85
2	143360	17 川发 01	80,000	8,375,200.00	9.62
3	101800808	18 衡阳城投MTN003	70,000	7,098,000.00	8.16
4	019654	21 国债 06	65,000	6,505,850.00	7.47
5	1780150	17 黄岩债 01	100,000	6,265,000.00	7.20

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

2021年1月14日，衡阳市城市建设投资有限公司（简称：衡阳城投）由于提供不真实统计资料，受到湖南省统计局警告并处罚款。衡阳市经济财政相对较强，在湖南全省排名较为靠前，衡阳城投负责市土地开发、基础设施和保障房受托代建，业务公益属性强，政府支持强，该处罚对发行人信用资质影响较小。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，衡阳城投改正态度积极，并积极整改，上述事件发生后该公司经营状况正常。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对18衡阳城投MTN003进行了投资。

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,062.12
2	应收证券清算款	5,950.47
3	应收股利	-
4	应收利息	1,193,007.87
5	应收申购款	3,549.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,227,570.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	804,682.50	0.92
2	113044	大秦转债	429,466.40	0.49

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	创金合信稳健增利 6 个月持有期 A	创金合信稳健增利 6 个月持有期 C
报告期期初基金份额总额	81,865,400.36	10,728,357.87
报告期期间基金总申购份额	8,179,701.16	10,299,979.77
减：报告期期间基金总赎回份额	25,832,674.80	2,371,106.62
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	64,212,426.72	18,657,231.02

§ 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

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 9 月 30 日，创金合信基金共管理 74 只公募基金，公募管理规模 686 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 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梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

9.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日