
创金合信汇融一年定期开放混合型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 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

报告送出日期:2020 年 10 月 28 日

目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示..... | 3 |
| §2 基金产品概况..... | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 4 |
| 3.1 主要财务指标..... | 4 |
| 3.2 基金净值表现..... | 4 |
| §4 管理人报告..... | 6 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介..... | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 7 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 7 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析..... | 7 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 8 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 8 |
| §5 投资组合报告..... | 8 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 8 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 9 |
| 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..... | 9 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 10 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 10 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 11 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 12 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 12 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 12 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 12 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 13 |
| §9 备查文件目录..... | 13 |
| 9.1 备查文件目录..... | 13 |
| 9.2 存放地点..... | 13 |
| 9.3 查阅方式..... | 13 |

§ 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2020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2020年07月01日起至2020年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 创金合信汇融一年定开混合 |
| 基金主代码 | 009454 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年06月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,000,237,146.13份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+中债综合（全价）指数收益率×40% |
| 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、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 | 创金合信汇融一年定开混合A | 创金合信汇融一年定开混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009454 | 009455 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,000,224,936.11份 | 12,210.02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(2020年07月01日 - 2020年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|---------------|
| | 创金合信汇融一年定开混合A | 创金合信汇融一年定开混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 969,774.05 | -0.20 |
| 2. 本期利润 | -6,941,811.16 | -96.63 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0069 | -0.0079 |
| 4. 期末基金资产净值 | 993,434,142.99 | 12,113.67 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9932 | 0.9921 |

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

创金合信汇融一年定开混合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 | -0.70% | 0.37% | 5.58% | 0.95% | -6.28% | -0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.68% | 0.35% | 7.91% | 0.92% | -8.59% | -0.57% |

创金合信汇融一年定开混合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 | -0.79% | 0.37% | 5.58% | 0.95% | -6.37% | -0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.79% | 0.35% | 7.91% | 0.92% | -8.70% | -0.57% |

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

创金合信汇融一年定开混合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



注：1、本基金的基金合同于 2020 年 06 月 18 日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，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。

创金合信汇融一年定开混合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



§ 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 | | |
| 曹春林 | 本基金基金经理 | 2020-06-18 | - | 15年 | 曹春林先生，中国国籍，厦门大学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作。2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作。2010年4月加盟第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-----------------------|
| | | | | | 资管投资部副总监兼投资经理，现任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------|

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》、《证券投资基金销售管理办法》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

经历了二季度的大涨，2020年第三季度A股市场进入横盘整理期，成交量从之前的日均万亿元下降至日均八千亿左右的水平，市场情绪明显回落，前期热门板块医药、芯片、消费和农业板块均出现不小幅度的回调；但是市场并没有因此出现大幅回落，而是向电气设备、光伏玻璃、新能源汽车等板块轮动。宏观层面，新冠肺炎疫情对经济负面冲击高峰已经过去，经济基本面处于逐渐复苏的态势，货币政策从“危机模式”逐步回归常态化，货币政策取向更加灵活适度、精准导向，实现稳增长和防风险长期均衡。对于2020年第四季度，国内经济处于向潜在增速恢复的过程，但复苏的力度整体趋缓。当前固定资产投资处于逐步回升的状态，房地产和基建投资增速上行，制造业投资较疲软，出口表现好于预期。随着经济恢复，逆周期调节政策力度减缓，基建投资后续可能放缓，房地产调控政策趋严，后续经济恢复力度可能放缓。

A股市场在经历了前期的横盘整理之后，情绪被消化得较为充分，在诸多不确定因素影响下，仍然表现稳健，让我们对未来市场更有信心。第四季度，随着经济复苏的持续，A股市场的内部环境阻力在减小，压力主要来自外部环境（美国大选、新冠疫情二次爆发、地缘政治风险等）。展望下一阶段，股票市场或将在板块轮动的基础上震荡上行，前期走势偏弱的低估值行业及景气度较高的行业有望产生超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信汇融一年定开混合A基金份额净值为0.9932元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率为5.58%；截至报告期末创金合信汇融一年定开混合C基金份额净值为0.9921元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.79%，同期业绩比较基准收益率为5.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未出现连续二十个工作日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

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 474,778,275.28 | 45.04 |
| | 其中：股票 | 474,778,275.28 | 45.04 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 250,000,000.00 | 23.72 |
| | 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 | 194,943,390.91 | 18.49 |
| 8 | 其他资产 | 134,331,378.11 | 12.74 |
| 9 | 合计 | 1,054,053,044.30 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 73,863,523.80 | 7.44 |
| C | 制造业 | 227,561,183.13 | 22.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 32,319,139.61 | 3.25 |
| E | 建筑业 | 5,733,600.00 | 0.58 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,611,230.00 | 0.67 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 78,179,404.34 | 7.87 |
| J | 金融业 | 37,393,284.40 | 3.76 |
| K | 房地产业 | 13,116,910.00 | 1.32 |
| 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 | 474,778,275.28 | 47.79 |

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 | 600489 | 中金黄金 | 6,141,249 | 57,911,978.07 | 5.83 |
| 2 | 000050 | 深天马A | 3,660,323 | 51,207,918.77 | 5.15 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 3 | 002373 | 千方科技 | 1,906,578 | 39,637,756.62 | 3.99 |
| 4 | 300075 | 数字政通 | 2,400,000 | 29,928,000.00 | 3.01 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 389,940 | 29,736,824.40 | 2.99 |
| 6 | 600732 | 爱旭股份 | 1,816,680 | 23,580,506.40 | 2.37 |
| 7 | 601016 | 节能风电 | 8,032,129 | 20,642,571.53 | 2.08 |
| 8 | 688012 | 中微公司 | 112,359 | 17,230,252.65 | 1.73 |
| 9 | 603019 | 中科曙光 | 322,640 | 12,169,980.80 | 1.23 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 175,207 | 10,009,575.91 | 1.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 134,445,497.38 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -114,119.27 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 134,331,378.11 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600489 | 中金黄金 | 57,911,978.07 | 5.83 | 非公开发行限售 |
| 2 | 000050 | 深天马A | 51,207,918.77 | 5.15 | 非公开发行限售 |
| 3 | 002373 | 千方科技 | 39,637,756.62 | 3.99 | 非公开发行限售 |
| 4 | 300075 | 数字政通 | 29,928,000.00 | 3.01 | 非公开发行限售 |
| 5 | 600732 | 爱旭股份 | 23,580,506.40 | 2.37 | 非公开发行限售 |

| | | | | | |
|---|------------|----------|---------------|------|-------------|
| 6 | 60101 6 | 节能 风电 | 20,642,571.53 | 2.08 | 非公开发行 限售 |
| 7 | 68801 2 | 中微 公司 | 17,230,252.65 | 1.73 | 老股东转让 限售 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 创金合信汇融一年定开 混合A | 创金合信汇融一年定开 混合C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,000,224,936.11 | 12,210.02 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 1,000,224,936.11 | 12,210.02 |

§ 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

本基金无基金管理人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 | 20200701 - 20200930 | 240,049,400.00 | 0.00 | 0.00 | 240,049,400.00 | 24.00% |
| | 2 | 20200701 - 20200930 | 280,057,800.00 | 0.00 | 0.00 | 280,057,800.00 | 28.00% |
| | 3 | 20200701 - 20200930 | 240,049,400.00 | 0.00 | 0.00 | 240,049,400.00 | 24.00% |
| | 4 | 20200701 - 20200930 | 240,032,600.00 | 0.00 | 0.00 | 240,032,600.00 | 24.00% |
| 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) 若本基金在短期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，未出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、《创金合信汇融一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信汇融一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信汇融一年定期开放混合型证券投资基金2020年第3季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2020年10月28日