
创金合信国企活力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	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
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	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	7
§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	8
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	9
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	9
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	10
§6 开放式基金份额变动	11
§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	11
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	创金合信国企活力混合
基金主代码	004112
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月23日
报告期末基金份额总额	15,711,801.33份
投资目标	通过精选个股和风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”的大类资产配置框架，综合宏观经济走势、货币市场、资本市场表现，以及国家重大政治、经济与产业政策等政策因素，形成对大类资产预期风险及预期收益水平的判断，进而确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+一年期人民币定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 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）
1. 本期已实现收益	2,092,860.66
2. 本期利润	2,111,671.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1259
4. 期末基金资产净值	19,744,515.77
5. 期末基金份额净值	1.257

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

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	8.46%	1.57%	8.29%	1.29%	0.17%	0.28%
过去六个月	19.71%	1.28%	19.51%	1.06%	0.20%	0.22%
过去一年	29.32%	1.36%	16.71%	1.11%	12.61%	0.25%
过去三年	19.37%	1.18%	17.66%	1.07%	1.71%	0.11%
自基金合同生效起至今	25.70%	1.08%	31.33%	0.98%	-5.63%	0.10%

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

创金合信国企活力混合型证券投资基金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	2019-09-25	-	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。
黄弢	本基金基金经理、权益投资部总监	2020-05-08	-	18 年	黄弢先生，中国国籍，清华大学法学硕士，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，任权益投资部总监，兼任基金经理。

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》、《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

2020年三季度初，在金融板块的带动下，市场延续第二季度的反弹趋势，走出了快速上扬的走势。从实体经济角度看，投资、出口和消费都进入强恢复的状态，与此相关的金融、地产、化工、建仓、家电、汽车等顺周期、低估值板块相对表现更好。本基金第三季度的配置以国企中的白马核心资产为主，未来仍会聚焦于上述行业中景气度恢复良好，且具有更佳估值优势的龙头个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国企活力混合基金份额净值为1.257元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.46%，同期业绩比较基准收益率为8.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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	16,952,280.30	85.13
	其中：股票	16,952,280.30	85.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,873.00	0.64
	其中：债券	126,873.00	0.64
	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	2,721,552.74	13.67
8	其他资产	112,813.62	0.57
9	合计	19,913,519.66	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	-	-
C	制造业	9,852,008.30	49.90
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	488,125.00	2.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	391,092.00	1.98
J	金融业	5,570,991.00	28.22
K	房地产业	650,064.00	3.29
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	16,952,280.30	85.86

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	600036	招商银行	44,300	1,594,800.00	8.08
2	000651	格力电器	29,800	1,588,340.00	8.04
3	601318	中国平安	20,500	1,563,330.00	7.92
4	000063	中兴通讯	45,006	1,489,698.60	7.54
5	002202	金风科技	142,400	1,456,752.00	7.38
6	600030	中信证券	40,700	1,222,221.00	6.19
7	601939	建设银行	193,600	1,190,640.00	6.03
8	600585	海螺水泥	20,000	1,105,200.00	5.60
9	600104	上汽集团	46,200	883,806.00	4.48
10	600741	华域汽车	35,300	878,970.00	4.45

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	126,873.00	0.64
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	126,873.00	0.64

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	019627	20国债01	1,270	126,873.00	0.64

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	7,760.94
2	应收证券清算款	99,193.42
3	应收股利	-
4	应收利息	2,345.50
5	应收申购款	3,513.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	112,813.62

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

报告期期初基金份额总额	20,210,666.61
报告期期间基金总申购份额	865,658.60
减：报告期期间基金总赎回份额	5,364,523.88
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	15,711,801.33

§ 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**

本基金在报告期内不存在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

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、《创金合信国企活力混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国企活力混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国企活力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