
创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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:2021 年 01 月 22 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	11
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	11
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	11
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	11
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	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	13
§9 影响投资者决策的其他重要信息	13
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	14
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	14
§10 备查文件目录	14
10.1 备查文件目录	14
10.2 存放地点	14
10.3 查阅方式	14

§ 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01月18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10月01日起至2020年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信科技成长股票
基金主代码	005495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月28日
报告期末基金份额总额	290,439,443.23份
投资目标	本基金主要投资于预期成长性良好的科技行业股票，通过对行业景气周期的判断和个股精选，追求超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。
业绩比较基准	中证高新技术企业指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

下属分级基金的基金简称	创金合信科技成长股票A	创金合信科技成长股票C
下属分级基金的交易代码	005495	005496
报告期末下属分级基金的份额总额	246,294,658.12份	44,144,785.11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10月01日 - 2020年12月31日)	
	创金合信科技成长股票A	创金合信科技成长股票C
1. 本期已实现收益	39,730,073.60	7,195,720.75
2. 本期利润	63,860,184.58	11,824,959.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2072	0.1994
4. 期末基金资产净值	470,544,514.14	82,854,122.20
5. 期末基金份额净值	1.9105	1.8769

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

创金合信科技成长股票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	12.25%	1.51%	-3.36%	1.28%	15.61%	0.23%
过去六个月	12.86%	1.95%	-4.39%	1.60%	17.25%	0.35%
过去一年	44.61%	2.12%	22.06%	1.83%	22.55%	0.29%
过去三年	90.97%	1.92%	42.44%	1.76%	48.53%	0.16%
自基金合同生效起至今	91.05%	1.92%	43.66%	1.76%	47.39%	0.16%

创金合信科技成长股票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	12.11%	1.51%	-3.36%	1.28%	15.47%	0.23%
过去六个月	12.58%	1.95%	-4.39%	1.60%	16.97%	0.35%
过去一年	43.89%	2.12%	22.06%	1.83%	21.83%	0.29%
过去三年	87.61%	1.92%	42.44%	1.76%	45.17%	0.16%
自基金合同生效起至今	87.69%	1.92%	43.66%	1.76%	44.03%	0.16%

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

创金合信科技成长股票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

(2017年12月28日-2020年12月31日)



创金合信科技成长股票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		
周志敏	本基金基金经理	2017-12-28	-	9年	周志敏先生，中国国籍，清华大学学士，中国科学院研究生院博士。历任广发证券股份有限公司研究员，第一创证券股份有限公司研究员，从事行业研究工作。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部研究员，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

本基金主要投资于预期成长性良好的科技行业股票。本基金的投资策略是通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，从定性和定量两个角度精选出发展前景良好或景气程度向好的行业，进行配置。定性分析层面，本基金以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。定量分析层面，本基金从各项财务指标和估值指标多维度综合判断行业景气度，指标数值较高的行业是本基金的投资重点。综合定性和定量分析结果，本基金确定不同行业的配置比例，并通过对经济周期、行业周期和行业景气度的持续跟踪，动态调整行业配置比例。

2020年Q4科技板块表现依旧平平，中证高新指数下跌3.92%，中证TMT指数下跌1.84%。我们认为科技股的下跌一方面与前期涨幅大估值高有关系，另一方面与其他行业板块表现更优关注度不足有关系。本基金产品是科技行业的主题基金，本期净值虽然取得了高于10%的上涨，仍然落后于其他热点行业的表现，但却验证了管理人在三季报中的判断，即“调整意味着风险的释放，代表着对悲观预期的反映。展望Q4，管理人认为科技板块未来一个季度的走势有望好于Q3。”

对于全年的总结和未来的展望，管理人会在后续的基金年报中做更详细的阐述。本期只简要谈谈对未来一个季度的看法。首先，当前市场的热点依然不在TMT为主的科技板块上，因此资金面对于科技行业来说可能还不会特别有利。科技板块的全面性的大行情还需要等待。但是机会可能就在此起彼伏中酝酿成熟。其次，年初的宏观层面一货币政策也好、产业政策也好，对于科技板块还是相对宽松的，去年四季度以来的行业景气度也保证了半导体、信创为代表的一些细分板块的业绩。因此，总体上未来一个季度科技板块的基本面也大概率是向好的。最后，在双循环的大格局下，中国经济稳中向好的基本面有望越走越强。中国科技行业进入到了需求与供给共振的新时代，有望保持较长时间的行业红利，有望继续涌现一批在细分赛道全球领先的公司。综上，基金管理人继续看好科技成长板块的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信科技成长股票A基金份额净值为1.9105元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.25%，同期业绩比较基准收益率为-3.36%；截至报告期末创金合信科技成长股票C基金份额净值为1.8769元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.11%，同期业绩比较基准收益率为-3.36%。

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	508,911,585.11	88.03
	其中：股票	508,911,585.11	88.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,330,966.80	1.79
	其中：债券	10,330,966.80	1.79
	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	34,700,030.73	6.00
8	其他资产	24,191,523.54	4.18
9	合计	578,134,106.18	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	462,184,899.04	83.52
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,520,606.70	7.14
J	金融业	7,033,900.00	1.27
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.01
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	48,261.27	0.01
S	综合	-	-
	合计	508,911,585.11	91.96

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	000725	京东方A	8,478,800	50,872,800.00	9.19
2	000100	TCL科技	5,677,173	40,194,384.84	7.26
3	300750	宁德时代	110,297	38,726,379.67	7.00
4	000049	德赛电池	315,806	21,348,485.60	3.86
5	002475	立讯精密	378,711	21,253,261.32	3.84
6	002938	鹏鼎控股	417,047	20,714,724.49	3.74
7	000063	中兴通讯	552,657	18,596,908.05	3.36
8	002460	赣锋锂业	167,162	16,916,794.40	3.06
9	600703	三安光电	611,393	16,513,724.93	2.98
10	002156	通富微电	639,300	16,135,932.00	2.92

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	10,330,966.80	1.87
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	10,330,966.80	1.87

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	103,320	10,330,966.80	1.87

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 江西赣锋锂业股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 4 月 13 日收到中国证券监督管理委员会江西监管局《关于对江西赣锋锂业股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2020】2 号）（以下简称“警示函”），认定公司存在内幕信息知情人登记管理不规范问题，一是未对重大投资进行内幕信息知情人登记，如未对收购阿根廷 Minera Exar 公司 37.5% 股权事项进行内幕信息知情人登记，二是内幕信息知情人登记不完整，2018 年定期报告内幕信息知情人登记中相关人员签名缺失。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，赣锋锂业公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。该公司作为锂行业龙头之一，目前锂价处于历史底部，随着需求好转锂价将底部回升，维持持有评级。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赣锋锂业进行了投资。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	404,810.54
2	应收证券清算款	23,118,131.97
3	应收股利	-
4	应收利息	233,134.84
5	应收申购款	435,446.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,191,523.54

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	000063	中兴通讯	15,479,000.00	2.80	大宗交易流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信科技成长股票 A	创金合信科技成长股票 C
报告期期初基金份额总额	341,884,809.13	69,042,194.32
报告期期间基金总申购份额	21,102,431.41	12,981,529.13
减：报告期期间基金总赎回份额	116,692,582.42	37,878,938.34
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	246,294,658.12	44,144,785.11

§ 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

单位：份

	创金合信科技成长股票A	创金合信科技成长股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2020-12-28	5,000,900.00	9,071,132.51	0
2	赎回	2020-12-29	5,000,900.18	9,145,146.16	0
合计			10,001,800.18	18,216,278.67	

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人高级管理人员	15,837.56	0.01%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	152.68	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	15,990.24	0.01%	0.00	0.00%	-

§ 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。

9.2 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金2020年第4季度报告原文。

10.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021年01月22日