

创金合信创新驱动股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 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

送出日期：2021 年 4 月 22 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..... | 5 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 9 |
| §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..... | 10 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 10 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 10 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 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..... | 11 |

§ 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 04 月 20 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 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 基金简称 | 创金合信创新驱动股票 | |
| 基金主代码 | 010495 | |
| 交易代码 | 010495 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 30 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 503,892,394.11 份 | |
| 投资目标 | 本基金主要投资于创新驱动主题相关的上市公司，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。 | |
| 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 | 中证科技驱动 100 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，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信创新驱动股票 A | 创金合信创新驱动股票 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010495 | 010496 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 476,685,011.46 份 | 27,207,382.65 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 01 月 01 日—2021 年 03 月 31 日） | |
|----------------|--|---------------|
| | 创金合信创新驱动股票 A | 创金合信创新驱动股票 C |
| 1.本期已实现收益 | -4,882,278.28 | -304,386.42 |
| 2.本期利润 | -41,322,484.49 | -2,291,039.59 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0854 | -0.0873 |
| 4.期末基金资产净值 | 435,962,804.48 | 24,833,520.77 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9146 | 0.9127 |

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

创金合信创新驱动股票 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 | -8.51% | 1.69% | -8.40% | 1.89% | -0.11% | -0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.54% | 1.66% | -4.46% | 1.90% | -4.08% | -0.24% |

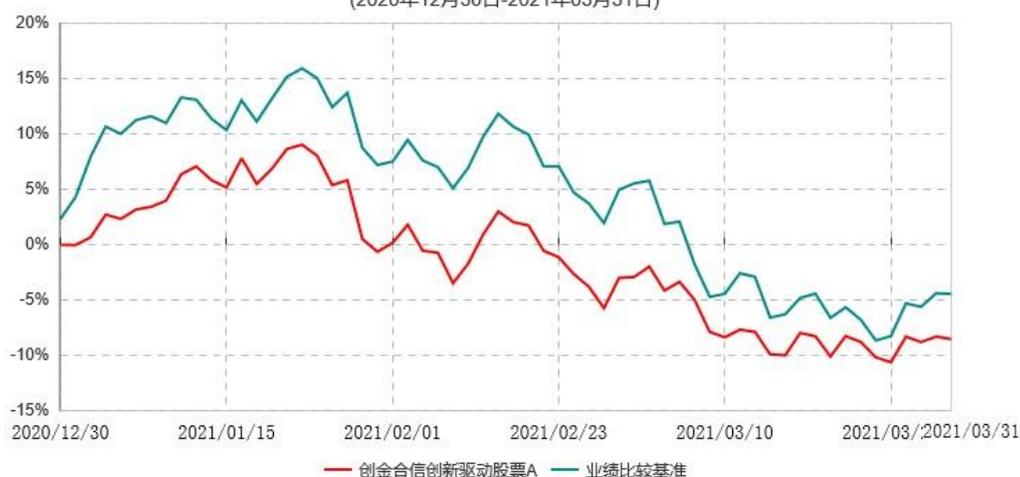
创金合信创新驱动股票 C

| 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 | -8.70% | 1.69% | -8.40% | 1.89% | -0.30% | -0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.73% | 1.66% | -4.46% | 1.90% | -4.27% | -0.24% |

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

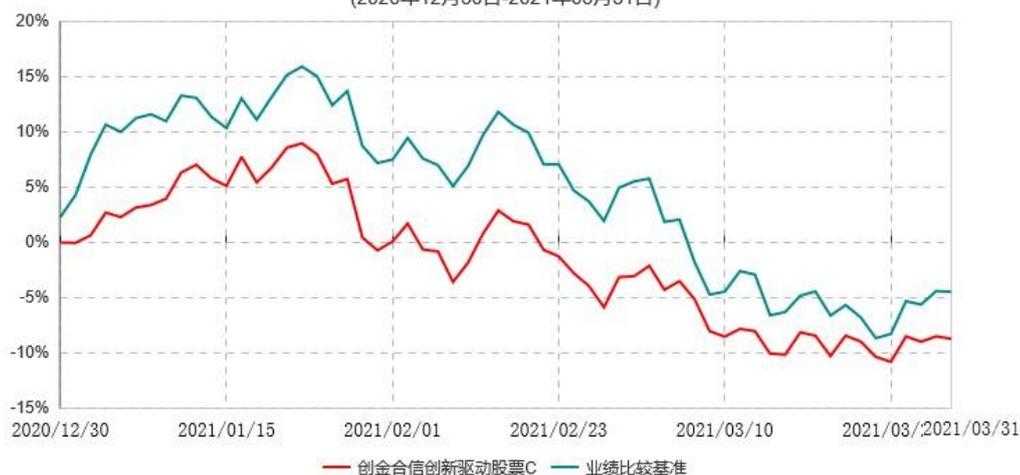
创金合信创新驱动股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年12月30日-2021年03月31日)



创金合信创新驱动股票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

(2020年12月30日-2021年03月31日)



注：1、本基金合同于2020年12月30日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期。

2、按照本基金的基金合同和招募说明书的约定，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。

§ 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 | 2020年12 | - | 9 | 周志敏先生，中国国籍，清华大学学士， |

| | | | | |
|--|----------|--------|--|---|
| | 基金经 理 | 月 30 日 | | 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

本基金主要投资于预期成长性良好的科技行业股票。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，进行重点配置。遵照合同约定，参考业绩比较基准，2021 年一季度，本基金绝大部分仓位配置在电子、通信和计算机三个板块。通过对行业和上市公司基本面的研究和对估值的考量，重点配置了与光学光电子、芯片、消费电子、关键软件等细分行业相关的个股。

回顾 2021 年一季度，A 股市场总体呈现前高后低的走势。科技板块在一季度表现出短暂的春季躁动，但持续性不强。流动性收紧预期给估值相对较高 A 股的科技板块带来了一定的调整压力。但另一方面也不缺乏投资机会。芯片供给持续紧张，涨价和缺货有愈演愈烈之势，一些被动元器件也呈现出相似的状态。面板行业浴火重生，进入到长期格局改善和短期业绩向上的新阶段。消费电子行业基本面表现稳健，前期的高估值已被部分消化。在前期披露的基金年报里管理人曾指出——估值和业绩两个方面都有提升空间的板在未来一年才可能才有戴维斯双升的机会，新一年的价值洼地可能要从之前没被充分关注的板块里去寻。一季度科技板块的行情已经阶段性和在一定层面上预演了管理人的判断。因此，我们继续看好竞争格局改善且短期业绩上行的面板行业，看好行业景气长期低迷后有望见底反转又有新技术新产品催化的 LED 行业，看好调整后估值合理的苹果产业链，看好成长空间大技术和产品突围的半导体板块，看好卡位优势显著行业持续增长的软件板块，看好电动车智能汽车相关的计算机通信电子相关公司的投资机会。

展望更远的未来，符合人类社会发展趋势，符合人民群众对美好生活的需要，而自身技术不断进步带来新产品、新服务、新模式的行业和公司仍有广阔的成长空间。就国内而言，无论国家安全、社会治理还是产业升级上都呼唤需要强大的科技产业支持。自上而下鼓励科技行业发展，补强科技行业短板的意愿不会逆转，同时科技行业发展又必须与资本市场相结合。从产业周期的角度来看，新基建、消费电子、物联网、芯片、云计算、关键软件等板块会带来科技行业的新一轮成长周期，相关公司的业绩有望从预期逐步走向落地，而目前上述板块都还处于产业周期的初期阶段。

本基金将继续寻找和投资这些行业中的领头羊，以期获取长期的投资回报。

在实际运作中，本基金根据行业和标的的特点采取有针对性的集中和分散。对于科技行业特征明显的赛道型机会，采取了分散持有的策略。对于竞争结构已然清晰的机会，采取重仓龙头个股的策略。同时，本基金严格遵守投资范围的约定，重点投资电子通信计算机三大核心科技行业。希望能为投资者提供投资范围清晰，风格稳定的基金产品。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信创新驱动股票 A 基金份额净值为 0.9146 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.51%，同期业绩比较基准收益率为-8.40%；截至本报告期末创金合信创新驱动股票 C 基金份额净值为 0.9127 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.70%，同期业绩比较基准收益率为-8.40%。

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 | 393,999,490.90 | 84.89 |
| | 其中：股票 | 393,999,490.90 | 84.89 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 69,939,536.65 | 15.07 |
| 8 | 其他资产 | 165,772.86 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 464,104,800.41 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 325,826,656.81 | 70.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 7,674.06 | 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 | 68,014,584.78 | 14.76 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 126,539.13 | 0.03 |
| 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 | 393,999,490.90 | 85.50 |

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 | 000725 | 京东方 A | 7,091,200 | 44,461,824.00 | 9.65 |
| 2 | 000100 | TCL 科技 | 4,453,417 | 41,594,914.78 | 9.03 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 636,500 | 21,532,795.00 | 4.67 |
| 4 | 000063 | 中兴通讯 | 538,500 | 15,788,820.00 | 3.43 |
| 5 | 002008 | 大族激光 | 349,500 | 14,804,820.00 | 3.21 |
| 6 | 002241 | 歌尔股份 | 465,700 | 12,643,755.00 | 2.74 |
| 7 | 603501 | 韦尔股份 | 46,793 | 12,012,698.96 | 2.61 |
| 8 | 600584 | 长电科技 | 307,500 | 10,513,425.00 | 2.28 |
| 9 | 300476 | 胜宏科技 | 441,000 | 10,341,450.00 | 2.24 |
| 10 | 600745 | 闻泰科技 | 101,100 | 9,907,800.00 | 2.15 |

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名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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 待摊费用 | - |
| 2 | 存出保证金 | 122,523.60 |
| 3 | 应收证券清算款 | 0.00 |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 应收利息 | 8,389.74 |
| 6 | 应收申购款 | 34,859.52 |

| | | |
|---|-------|------------|
| 7 | 其他应收款 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 165,772.86 |

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 | 15,788,820.00 | 3.43 | 停牌 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信创新驱动股票 A | 创金合信创新驱动股票 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 486,021,345.55 | 25,929,851.13 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,983,159.29 | 2,232,592.58 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 12,319,493.38 | 955,061.06 |
| 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 | 476,685,011.46 | 27,207,382.65 |

§ 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

本基金本报告期末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

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、《创金合信创新驱动股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信创新驱动股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信创新驱动股票型证券投资基金 2021 年 1 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

2021 年 4 月 22 日