创金合信新材料新能源股票型发起式证券投资基金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：交通银行股份有限公司

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.....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.....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.....6
5.1 报告期末基金资产组合情况.....6
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.....7
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.....8
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....8
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.....9
§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.....10
§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。

基金托管人交通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	创金合信新材料新能源股票	
基金主代码	011142	
交易代码	011142	
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	460,327,029.58 份	
投资目标	本基金精选新材料新能源行业中的优质股票，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，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	中证全指一级行业能源指数收益率×45%＋中证全指一级行业材料指数收益率×45%＋中债综合指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，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、混合型基金。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信新材料新能源股票 A	创金合信新材料新能源股票 C

下属分级基金的交易代码	011142	011143
报告期末下属分级基金的份额总额	254,032,367.21 份	206,294,662.37 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）	
	创金合信新材料新能源股票 A	创金合信新材料新能源股票 C
1.本期已实现收益	-584,721.76	-699,196.85
2.本期利润	-36,621,754.66	-31,407,534.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2138	-0.2211
4.期末基金资产净值	243,597,821.08	197,530,974.32
5.期末基金份额净值	0.9589	0.9575

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

创金合信新材料新能源股票 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	-4.18%	2.43%	4.50%	1.64%	-8.68%	0.79%
自基金合同生效起至今	-4.11%	2.39%	6.19%	1.61%	-10.30%	0.78%

创金合信新材料新能源股票 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	-4.32%	2.43%	4.50%	1.64%	-8.82%	0.79%

自基金合同生效起至今	-4.25%	2.39%	6.19%	1.61%	-10.44%	0.78%

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：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，截至报告期末基金尚未完成建仓。

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。

§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		
龚超	本基金基金经理	2021 年 3 月 29 日	-	9	龚超先生，中国国籍，上海财经大学经济学硕士。2011 年 6 月就职于浙商证券研究所，任化工行业研究员，2015 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司，任研究部研究员兼基金经理助理，2018 年 8 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理运营部投资主办，2021 年 3 月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
李游	本基金基金经理	2020 年 12 月 30 日	-	13	李游先生，中国国籍，中南财经政法大学金融学硕士，曾在五矿期货有限公司、华创证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司任研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司任研究部行业研究员，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

报告期内本基金通过自上而下和自下而上的投资方法来进行选股，以配置周期成长股为主。报告期内本基金重点投资于化工新材料和新能源两大方向。化工行业龙头公司在供给侧改革和碳中和长效机制下，周期波动性在收敛，而成长性在增强，很多化工龙头公司资本开支远超行业平均水平，因此本基金重点配置具备较强内生增长性的化工龙头公司。新能源行业的投资逻辑有外生和内生两点，内生逻辑是新能源的性价比越来越高，供给创造需求，行业的天花板非常高，外生逻辑是全球主要经济体自上而下的推动碳减排大大增强了新能源行业发展的确定性。经过春节后的一轮大幅下跌后，无论是化工龙头还是新能源龙头公司的估值都已经回到了合理区间，中长期的投资价值凸显。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信新材料新能源股票 A 基金份额净值为 0.9589 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.18%，同期业绩比较基准收益率为 4.50%；截至本报告期末创金合信新材料新能源股票 C 基金份额净值为 0.9575 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.32%，同期业绩比较基准收益率为 4.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§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	400,705,566.15	89.92
	其中：股票	400,705,566.15	89.92
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	43,254,897.05	9.71
8	其他资产	1,649,278.44	0.37
9	合计	445,609,741.64	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	400,206,722.07	90.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.01
E	建筑业	418,500.00	0.09
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,450.14	0.01
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	19,857.82	0.00
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	400,705,566.15	90.84

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	601012	隆基股份	486,586	42,819,568.00	9.71
2	300750	宁德时代	128,000	41,237,760.00	9.35
3	600438	通威股份	1,022,250	33,468,465.00	7.59
4	002812	恩捷股份	244,100	27,319,672.00	6.19
5	600309	万华化学	229,300	24,214,080.00	5.49
6	002271	东方雨虹	393,250	20,118,670.00	4.56
7	600176	中国巨石	1,024,100	19,662,720.00	4.46
8	600426	华鲁恒升	449,100	16,863,705.00	3.82
9	002601	龙蟒佰利	577,100	16,493,518.00	3.74
10	300274	阳光电源	207,700	14,908,706.00	3.38

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

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

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	-
3	应收证券清算款	0.00
4	应收股利	-
5	应收利息	6,383.86
6	应收申购款	1,642,894.58
7	其他应收款	-
8	其他	-
9	合计	1,649,278.44

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信新材料新能源股票A	创金合信新材料新能源股票C
报告期期初基金份额总额	38,982,375.39	35,522,143.80
报告期期间基金总申购份额	295,814,246.45	264,778,361.07
减：报告期期间基金总赎回份额	80,764,254.63	94,005,842.50
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	254,032,367.21	206,294,662.37

§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

项目	创金合信新材料新能源股票A	创金合信新材料新能源股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.97	2.42

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

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、《创金合信新材料新能源股票型发起式证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信新材料新能源股票型发起式证券投资基金托管协议》；

3、创金合信新材料新能源股票型发起式证券投资基金 2021 年 1 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路 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