

创金合信新能源汽车主题股票型发起 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：中国建设银行股份有限公司

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.....	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.....	10
§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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	11
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
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.....	12
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
§10 备查文件目录.....	12
10.1 备查文件目录.....	12
10.2 存放地点.....	12
10.3 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。

基金托管人中国建设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	创金合信新能源汽车股票	
基金主代码	005927	
交易代码	005927	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 8 日	
报告期末基金份额总额	279,023,242.97 份	
投资目标	本基金主要投资新能源汽车主题股票，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	中证新能源汽车产业指数收益率*90%+人民币活期存款利率（税后）*10%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信新能源汽车股票 A	创金合信新能源汽车股票 C
下属分级基金的交易代码	005927	005928
报告期末下属分级基金的份额总额	101,748,450.31 份	177,274,792.66 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）	
	创金合信新能源汽车股票 A	创金合信新能源汽车股票 C
1.本期已实现收益	-4,243,370.07	-8,396,583.91
2.本期利润	-30,126,703.97	-46,596,145.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3063	-0.2991
4.期末基金资产净值	201,568,852.39	343,885,148.28
5.期末基金份额净值	1.9811	1.9398

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

创金合信新能源汽车股票 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	-8.19%	2.92%	-10.52%	2.68%	2.33%	0.24%
过去六个月	38.20%	2.59%	30.59%	2.44%	7.61%	0.15%
过去一年	83.08%	2.29%	85.21%	2.12%	-2.13%	0.17%
自基金合同生效起至今	98.11%	1.78%	49.98%	1.85%	48.13%	-0.07%

创金合信新能源汽车股票 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	-8.35%	2.92%	-10.52%	2.68%	2.17%	0.24%
过去六个月	37.72%	2.59%	30.59%	2.44%	7.13%	0.15%
过去一年	81.82%	2.29%	85.21%	2.12%	-3.39%	0.17%

自基金合同生效起至今	93.98%	1.78%	49.98%	1.85%	44.00%	-0.07%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

创金合信新能源汽车股票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

(2018年05月08日-2021年03月31日)



创金合信新能源汽车股票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

(2018年05月08日-2021年03月31日)



§ 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	2018年5月8日	-	16	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

	理				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

2021 年一季度在疫苗开始接种的情况下，全球经济加速复苏。上游原材料涨价明显，由于需求强劲芯片也出现了短缺。在发达经济体中美国经济复苏领先于欧洲，美债收益开始回升。

受美债收益率上升影响，美国纳斯达克指数出现了较大波动。中国市场也开始对前期上涨过快、涨幅过大进行了修正，前期涨幅较大、估值较贵的核心资产有较明显的调整。

展望 2021 全年，宏观经济大概率是经济复苏和流动性边际收缩并行，对应权益市场是整体估值会被压缩，市场会更关注业绩增速，因为只有业绩高增长的个股才能抵御估值压缩的风险并有望获取正收益。

一季度新能源汽车行业延续了去年四季的高景气，产业链龙头均处于满产状态。除了中国、欧洲外，美国市场开始高速增长。行业由政策驱动转变为技术驱动和产品驱动。预计未来几年新能源汽车行业会是新兴产业中增速最快的行业之一。

本产品将继续配置新能源汽车行业中竞争格局好、业绩增长快的龙头个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信新能源汽车股票 A 基金份额净值为 1.9811 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.19%，同期业绩比较基准收益率为-10.52%；截至本报告期末创金合信新能源汽车股票 C 基金份额净值为 1.9398 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.35%，同期业绩比较基准收益率为-10.52%。

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	446,997,699.15	79.50
	其中：股票	446,997,699.15	79.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,678,862.90	1.01
	其中：债券	5,678,862.90	1.01
	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	101,894,180.59	18.12
8	其他资产	7,661,234.30	1.36
9	合计	562,231,976.94	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	33,098,784.00	6.07
C	制造业	413,784,543.05	75.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,493.82	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	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	33,392.02	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	446,997,699.15	81.95

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	300750	宁德时代	161,600	52,062,672.00	9.54
2	688005	容百科技	872,714	49,858,150.82	9.14
3	600884	杉杉股份	3,297,550	48,111,254.50	8.82
4	603799	华友钴业	673,433	46,291,784.42	8.49
5	002460	赣锋锂业	478,600	45,112,836.00	8.27
6	688388	嘉元科技	581,104	43,216,704.48	7.92
7	000725	京东方 A	6,798,700	42,627,849.00	7.82
8	603993	洛阳钼业	4,984,000	26,315,520.00	4.82

9	002497	雅化集团	1,518,832	26,063,157.12	4.78
10	600660	福耀玻璃	392,600	18,091,008.00	3.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,678,862.90	1.04
	其中：政策性金融债	5,678,862.90	1.04
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	5,678,862.90	1.04

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

金额单位：人民币元

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	108604	国开 1805	56,478	5,678,862.90	1.04

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

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。该公司作为锂资源行业龙头之一，目前锂价从底部快速回升，随着需求好转锂价有望进一步升高，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。

宁波容百新能源科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 4 月 10 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于对宁波容百新能源科技股份有限公司采取 1 年内不接受发行人公开发行证券相关文件的监管措施的决定》（(2020)4 号，以下简称“《行政监管措施决定书》”）。认定公司在申请科创板首次公开发行股票过程中，招股说明书中信息披露存在以下问题：

一、未充分披露比克动力信用风险大幅增加情况。你公司于 2019 年 7 月 1 日起将比克动力信用额度调整为 0，但招股说明书（签署日为 7 月 16 日）中未披露该事项并充分提示风险。

二、未披露比克动力“回款”的实质为以自身开具商业承兑汇票偿还逾期应收账款。在招股说明书中披露“截至 2019 年 6 月 25 日，比克动力通过银行承兑汇票、商业承兑汇票及电汇合计回款金额为 10,561.62 万元，回款比例约为 49%”。上述还款中，比克动力开具的商业承兑汇票总计 7,002.84 万元，占总回款的 66.30%，但你公司未披露回款是以自身开具的商业承兑汇票为主的情况。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，容百科技公司改正态度积极，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。该公司作为高镍三元正极材料龙头，目前客户结构良好，产量处于快速扩张期，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容百科技进行了投资。

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

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	229,854.36
3	应收证券清算款	5,935,980.76
4	应收股利	-
5	应收利息	130,225.42
6	应收申购款	1,365,173.76
7	其他应收款	0.00
8	其他	-
9	合计	7,661,234.30

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	创金合信新能源汽车股票 A	创金合信新能源汽车股票 C
报告期期初基金份额总额	46,947,137.99	55,143,630.31
报告期期间基金总申购份额	156,848,076.09	314,304,291.50
减：报告期期间基金总赎回份额	102,046,763.77	192,173,129.15
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	101,748,450.31	177,274,792.66

§ 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	创金合信新能源汽车股票 A	创金合信新能源汽车股票 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,200.04	5,000,200.00
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	5,000,200.04	5,000,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.91	2.82

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 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	10,000,400.04	3.58	10,000,400.04	3.58	36 月
基金管理人高级管理人员	19,056.93	0.01	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人	-	-	-	-	-

股东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,019,456.97	3.59	10,000,400.04	3.58	36 月

§ 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。

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、《创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金 2021 年 1 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 4 月 22 日