

嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 07 月 21 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	6
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	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	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	9
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	9
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	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	10
§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 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	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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年07月19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，投资者在做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04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉合锦创优势精选混合
基金主代码	006992
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月16日
报告期末基金份额总额	1,250,358.45份
投资目标	本基金在追求有效控制风险和保持资金流动性的前提下，基于较为中长期的持股周期和较为合理的风险收益比，运用“核心+卫星”策略，精选具备良好成长性的股票和被市场低估的价值股，注重安全边际，同时兼顾主题和趋势投资机会，力争为持有人资产追求可持续的、中长期的稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的基本面分析体系，坚持“自下而上”为主、“自上而下”为辅的投资视角，通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，精选出具有中长期价值持续增长或者被显著低估的上市公司，运用“核心+卫星”策略，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力求为持有人资产追求可持续的、中长期的稳定增值。

业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	嘉合基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 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（2021年04月01日 - 2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	24,829.35
2. 本期利润	309,110.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2265
4. 期末基金资产净值	2,330,952.42
5. 期末基金份额净值	1.8642

注：1、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。

2、所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。

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	14.05%	1.02%	2.87%	0.78%	11.18%	0.24%
过去六个月	11.80%	1.70%	0.33%	1.05%	11.47%	0.65%
过去一年	36.37%	1.71%	20.33%	1.06%	16.04%	0.65%
自基金合同生效起至今	86.42%	1.31%	25.57%	1.04%	60.85%	0.27%

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

嘉合锦创优势精选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

(2019年04月16日-2021年06月30日)



注：截至本报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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		
骆海涛	权益投资部副总监、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合医疗健康混合型发起式证券投资基金的基金经理	2019-04-16	2021-05-28	11年	美国密歇根大学金融工程硕士，亚利桑那大学光学博士，上海交通大学应用物理学学士和凝聚态物理硕士，拥有11年金融从业经历。曾任美国普氏能源(Platts)公司量化分析师，平安资产管理公司和

					平安投管中心任战略资产配置团队负责人。2015年加入嘉合基金管理有限公司。
杨彦喆	嘉合消费升级混合型发起式证券投资基金、嘉合医疗健康混合型发起式证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股股票型证券投资基金的基金经理	2020-06-22	-	5年	伯明翰大学金融工程硕士，南京大学工业工程学士，5年金融从业经验2015年加入嘉合基金管理有限公司量化投资部，负责量化选股、期货CTA策略和量化策略平台的开发。

注：1、骆海涛的“任职日期”为基金合同生效日，杨彦喆的“任职日期”为公告确定的聘任日期，骆海涛的“离任日期”为公告确定的离任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

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存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年4月以来，随着全球疫情有所缓和，国内经济平稳、全球货币市场资金加速回流风险资产，国内外通胀预期逐步下行，市场流动性宽松略超预期，权益市场成长风格走强。体现在A股市场创业板指、科创板等新兴成长方向表现较好。嘉合锦创优势精选在二季度实现14.05%的收益，超越同期沪深300、中证500指数涨幅。组合构建方面，

我们持续超配成长，一方面关注高成长高景气行业，如集成电路、光伏、新能源汽车、机器人、医疗器械等高端制造业等，另一方面关注中报业绩超预期的高性价比资产，如钢铁、化工等。展望三季度，我们将继续关注中报维持高增速的行业及个股，以期为消费者创造良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合锦创优势精选混合基金份额净值为1.8642元，本报告期内，基金份额净值增长率为14.05%，同期业绩比较基准收益率为2.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2020年2月14日起至2021年6月30日基金资产净值低于人民币五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按照法律法规和基金合同的要求向中国证监会报告并提交了解决方案。

§ 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	1,885,458.80	76.94
	其中：股票	1,885,458.80	76.94
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	552,953.43	22.56
8	其他资产	12,193.77	0.50
9	合计	2,450,606.00	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	1,545,278.80	66.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,960.00	3.47
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	155,710.00	6.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	103,510.00	4.44
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	1,885,458.80	80.89

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	601012	隆基股份	2,780	246,975.20	10.60
2	603893	瑞芯微	1,500	209,190.00	8.97
3	002841	视源股份	1,400	174,006.00	7.47
4	002241	歌尔股份	4,000	170,960.00	7.33

5	002352	顺丰控股	2,300	155,710.00	6.68
6	000725	京东方 A	23,000	143,520.00	6.16
7	600460	士兰微	2,500	140,875.00	6.04
8	600660	福耀玻璃	2,500	139,625.00	5.99
9	002027	分众传媒	11,000	103,510.00	4.44
10	600703	三安光电	3,000	96,150.00	4.12

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序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

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,414.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	115.59
5	应收申购款	10,664.01
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,193.77

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	600460	士兰微	140,875.00	6.04	停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,350,716.06
报告期期间基金总申购份额	514,600.37

减：报告期期间基金总赎回份额	614,957.98
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	1,250,358.45

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本基金管理人本报告期末持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未运用固有资金对本基金进行交易。

§ 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期无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

- 一、中国证监会准予嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司

2021年07月21日