

创金合信创新驱动股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 月 30 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 10 月 27 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.....	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.....	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.....	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.....	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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 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	244,395,029.06 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	177,872,563.35 份	66,522,465.71 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 7 月 1 日—2021 年 9 月 30 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	9,115,416.36	114,165.53
2.本期利润	-17,046,004.59	-2,181,129.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0804	-0.0962
4.期末基金资产净值	172,245,184.77	64,035,078.89
5.期末基金份额净值	0.9684	0.9626

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	-9.22%	1.37%	-3.08%	1.51%	-6.14%	-0.14%
过去六个月	5.88%	1.33%	16.92%	1.42%	-11.04%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-3.16%	1.45%	11.70%	1.59%	-14.86%	-0.14%

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	-9.41%	1.37%	-3.08%	1.51%	-6.33%	-0.14%
过去六个月	5.47%	1.33%	16.92%	1.42%	-11.45%	-0.09%

自基金合同生效起至今	-3.74%	1.45%	11.70%	1.59%	-15.44%	-0.14%
------------	--------	-------	--------	-------	---------	--------

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，截至报告期末，本基金成立未满一年。
2、本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
周志敏	本基金基金经理	2020 年 12 月 30 日	-	10	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。本基金所称创新驱动主题股票，是指遵循国家创新驱动战略，通过多元化创新方式（包括但不限于产品创新、技术创新、服务创新及制度创新等形式）驱

动企业发展和成长的企业，该类企业通常具有核心技术和研发实力，较高的品牌知名度以及良好的创新管理和文化，在市场竞争中具有优势和持续发展能力。

2021 年三季度，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 年三季度，A 股市场总体呈现震荡走势，大体上以中报披露为分水岭，前高后低。科技板块的表现与大盘走势类似，七月份开始半导体板块的带动下走高，九月份之后陆续呈现出兑现走低的行情。

回顾三季度和展望四季度，宏观层面、行业层面各种复杂因素交织在一起，为投资者的信心带来一些影响。芯片供给紧张程度虽然出现结构性分化的苗头，但对一些公司三季度的业绩造成了冲击。面板行业虽然进入到长期格局改善的阶段，但是由于前期涨价幅度过大对下游需求产生了一定程度抑制，再叠加海运不畅的影响，价格从三季度开始快速下跌。

和短期业绩向上的新阶段。消费电子行业受供应链稳定和需求疲软影响表现平平，上游元器件的涨价和缺货年底又开始影响下游制造环节的利润。尽管短期似乎没有太多乐观因素，但是从从业十年以来，管理人看到的创新型业的基本面从来就不是简单的周期重复，而是一轮一轮的调整中不断向上突破。以过去十年最大的风口苹果产业链为例，行业里几十家公司，有起有落，但是我们从财务报表上看到行业里的优质公司每隔几年收入利润就能上一个新台阶，我们从股价上看到公司市值同时也能上一个新台阶，我们去调研更能看到公司技术生产管理品牌形象各个维度的提升。而那些追赶者在行业技术发展更前列的芯片公司、面板公司、软件公司、通信设备公司，也是同样在每轮周期中越做越大越做越强。科技行业总体上是一个需要不断投入的辛苦行业，不能像传统行业那样“躺赢”，但是星光不负赶路人，持之以恒，未来时间还是会选择他们做朋友。

尽管宏观形势依然充满了不确定性，但是从高层今年历次的表态来看，科技与创新都是被摆在重要的位置上。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。

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 0.9684 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.22%，同期业绩比较基准收益率为-3.08%；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 0.9626 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.41%，同期业绩比较基准收益率为-3.08%。

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	195,792,383.38	79.80
	其中：股票	195,792,383.38	79.80
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	30,168,545.96	12.30
8	其他资产	19,378,685.73	7.90
9	合计	245,339,615.07	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	18,116.82	0.01
B	采矿业	-	-

C	制造业	157,815,641.92	66.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,299,875.22	2.67
E	建筑业	20,183.39	0.01
F	批发和零售业	61,969.47	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,506,241.40	13.33
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	19,443.64	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.02
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	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	195,792,383.38	82.86

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	002241	歌尔股份	425,400	18,334,740.00	7.76
2	000063	中兴通讯	339,200	11,237,696.00	4.76
3	300870	欧陆通	137,500	9,684,125.00	4.10
4	002236	大华股份	397,700	9,433,444.00	3.99
5	300866	安克创新	68,500	7,334,295.00	3.10
6	000100	TCL 科技	1,148,717	7,190,968.42	3.04
7	600703	三安光电	220,571	6,989,894.99	2.96
8	000725	京东方 A	1,351,500	6,825,075.00	2.89
9	300476	胜宏科技	238,100	6,762,040.00	2.86
10	688066	航天宏图	141,324	6,428,828.76	2.72

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	存出保证金	130,464.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,755.43
5	应收申购款	19,245,466.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,378,685.73

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 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	325,526,974.18	24,793,952.70
报告期期间基金总申购份额	11,428,889.96	55,419,609.01
减：报告期期间基金总赎回份额	159,083,300.79	13,691,096.00
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	177,872,563.35	66,522,465.71

§ 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

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 9 月 30 日，创金合信基金共管理 74 只公募基金，公募管理规模 686 亿元。

§ 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 3 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日