

创金合信尊泓债券型证券投资基金 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：恒丰银行股份有限公司

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.....	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.....	7
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.....	7
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.....	8
5.11 投资组合报告附注.....	8
§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.....	9
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	9
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	9
§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.....	10
9.1 备查文件目录.....	10
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。

基金托管人恒丰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 14 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信尊泓债券	
基金主代码	012938	
交易代码	012938	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 14 日	
报告期末基金份额总额	1,999,632,668.27 份	
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金投资于评级在 AA 及以上级别的信用债，其中评级为 AA 的信用债投资占信用债的比例为 0%-20%，评级为 AA+ 的信用债投资占信用债的比例为 0-50%，评级为 AAA 的信用债投资占信用债的比例为 50%-100%。上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，评级机构不包含中债资信。	
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金、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	恒丰银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信尊泓债券 A	创金合信尊泓债券 C

下属分级基金的交易代码	012938	012939
报告期末下属分级基金的份额总额	1,999,628,613.27 份	4,055.00 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	2021 年 7 月 14 日(基金合同生效日)-2021 年 9 月 30 日	
	创金合信尊泓债券 A	创金合信尊泓债券 C
1.本期已实现收益	10,881,679.07	20.40
2.本期利润	3,005,680.64	4.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015	0.0011
4.期末基金资产净值	2,002,612,095.50	4,059.43
5.期末基金份额净值	1.0015	1.0011

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、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 14 日，截至本报告期末，本基金成立不满一季度。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

创金合信尊泓债券 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
自基金合同生效起至今	0.15%	0.02%	0.28%	0.05%	-0.13%	-0.03%

创金合信尊泓债券 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
自基金合同	0.11%	0.02%	0.28%	0.05%	-0.17%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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 2021 年 7 月 14 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
张贺章	本基金基金经理	2021 年 7 月 14 日	-	5	张贺章先生，中国国籍，桂林电子科技大学管理学硕士。2011 年 6 月就职于北京和君咨询有限公司，任企业管理咨询部咨询师。2012 年 8 月加入大公国际资信评估有限公司，历任工商企业二部分析师、行业组长、处经理。2016 年 2 月加入创金合信基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、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合规守信情况的说明

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 年三季度债券市场利率水平呈现先下后上的行情。长端方面，10 年国债利率在央行降准操作的带动下，从 7 月初 3.05%附近下行至 9 月末 2.85%附近，短端方面，三季度 7 天回购利率 DR007 平均值为 2.16%，与二季度基本持平，也与央行稳健中性的货币政策的基调相匹配。三季度债券市场行情的主要驱动力在于央行 7 月份意外降准的行为带动了市场宽松预期的提升，从而带来了收益率曲线的整体下行。随后则是市场在逐步修正过度宽松的货币政策预期，市场收益率逐步向上修复到合理水平附近。往后展望，四季度债券市场存在一定的分化压力，在理财净值化转型的背景下，利率债表现大概率强于信用债，短债表现大概率强于长债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信尊泓债券 A 基金份额净值为 1.0015 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%；截至本报告期末创金合信尊泓债券 C 基金份额净值为 1.0011 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,626,310,000.00	98.47
	其中：债券	2,626,310,000.00	98.47
	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	2,678,465.24	0.10

8	其他资产	38,215,626.42	1.43
9	合计	2,667,204,091.66	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	4,989,000.00	0.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,005,447,000.00	50.21
	其中：政策性金融债	481,559,000.00	24.05
4	企业债券	240,782,000.00	12.02
5	企业短期融资券	90,370,000.00	4.51
6	中期票据	1,284,722,000.00	64.15
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,626,310,000.00	131.14

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	190214	19 国开 14	2,500,000	251,325,000.00	12.55
2	2028019	20 平安银行小微债 01	1,800,000	178,668,000.00	8.92
3	2028041	20 工商银行二级 01	1,700,000	172,873,000.00	8.63
4	2028054	20 华夏银行	1,100,000	112,013,000.00	5.59
5	102100362	21 苏国信 MTN001	1,000,000	101,600,000.00	5.07

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

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	63,090.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,152,536.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,215,626.42

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

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信尊泓债券 A	创金合信尊泓债券 C
基金合同生效日(2021年7月14日)基金份额总额	201,005,037.09	4,065.00
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	3,799,234,773.17	10.00
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	2,000,611,196.99	20.00
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期末基金份额总额	1,999,628,613.27	4,055.00

§ 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自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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210714 - 20210930	99,999,000.00	1,899,619,076.18	0.00	1,999,618,076.18	100.00 %
机构	2	20210721 - 20210727	0.00	999,799,040.19	999,799,040.19	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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、《创金合信尊泓债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信尊泓债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信尊泓债券型证券投资基金 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日