

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 4 季度报告

2021 年 12 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：2022 年 1 月 21 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.....	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.....	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.....	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.....	11
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.....	11
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 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 10 月 1 日起至 12 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	421,420,615.51 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	227,073,510.50 份	194,347,105.01 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 10 月 1 日—2021 年 12 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	17,630,527.03	14,781,485.97
2.本期利润	-5,091,222.97	-3,347,702.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0221	-0.0164
4.期末基金资产净值	309,473,168.83	263,286,113.17
5.期末基金份额净值	1.3629	1.3547

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	-2.16%	1.94%	-6.95%	1.43%	4.79%	0.51%
过去六个月	5.78%	2.29%	11.99%	1.66%	-6.21%	0.63%
过去一年	36.19%	2.20%	29.01%	1.54%	7.18%	0.66%
自基金合同生效起至今	36.29%	2.19%	31.10%	1.54%	5.19%	0.65%

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	-2.31%	1.94%	-6.95%	1.43%	4.64%	0.51%
过去六个月	5.47%	2.29%	11.99%	1.66%	-6.52%	0.63%

过去一年	35.38%	2.20%	29.01%	1.54%	6.37%	0.66%
自基金合同生效起至今	35.47%	2.19%	31.10%	1.54%	4.37%	0.65%

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：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	-	10	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	-	14	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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十二条规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人会在十个交易日内进行调整。

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

报告期内本基金一如既往重点投资于新材料和新能源两大方向。在高质量发展的政策框架下，国内新材料行业具备较好的发展前景，有潜力为投资者创造较高的回报。新材料行业个股差异性比较大，本基金在深度研究的基础上，选择特钢、化工材料、有色金属材料等行业的优质标的，分散配置，重视公司长期成长性和估值优势。发展新能源、降低碳排放目前是全球共识，风电、光伏、核电等新能源具备比较大的成长空间。本基金高度重视供给端的技术变革，以及产业链各个环节的价值量和格局的变化，回避风险较大的标的。过去一年新能源新材料板块整体涨幅比较大，未来波动加剧难以避免，本基金选择具备成长性和估值优势的标的，优化配置，降低整个基金组合的估值水平，应对市场波动，追求长期回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信新材料新能源股票 A 基金份额净值为 1.3629 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.16%，同期业绩比较基准收益率为-6.95%；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 1.3547 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.31%，同期业绩比较基准收益率为-6.95%。

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	485,860,276.63	84.44
	其中：股票	485,860,276.63	84.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,883,677.80	2.93
	其中：债券	16,883,677.80	2.93
	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	16,714,682.60	2.90
8	其他资产	55,922,906.24	9.72
9	合计	575,381,543.27	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	20,332.12	0.00
B	采矿业	6,705,065.00	1.17
C	制造业	474,178,665.17	82.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,387,761.00	0.59
E	建筑业	28,041.83	0.00
F	批发和零售业	88,525.50	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	48,812.16	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	409,317.09	0.07
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	335,734.10	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	451,755.67	0.08
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	206,266.99	0.04
S	综合	-	-
	合计	485,860,276.63	84.83

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	657,160	56,647,192.00	9.89
2	300750	宁德时代	90,106	52,982,328.00	9.25
3	000708	中信特钢	1,502,800	30,777,344.00	5.37
4	002812	恩捷股份	115,400	28,896,160.00	5.05
5	603799	华友钴业	229,700	25,338,207.00	4.42
6	600309	万华化学	226,400	22,866,400.00	3.99
7	603806	福斯特	167,940	21,924,567.00	3.83
8	603985	恒润股份	369,200	19,722,664.00	3.44
9	300274	阳光电源	134,932	19,673,085.60	3.43
10	600438	通威股份	429,697	19,319,177.12	3.37

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	5,885,588.50	1.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,998,089.30	1.92
	其中：政策性金融债	10,998,089.30	1.92
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	16,883,677.80	2.95

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	018006	国开 1702	109,510	10,998,089.30	1.92
2	019628	20 国债 02	58,850	5,885,588.50	1.03

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

2021 年 5 月 31 日，江阴市恒润重工股份有限公司（以下简称“恒润股份”，股票代码 603985）发布公告，公司董事、副总经理周洪亮先生于近日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局（以下简称“江苏证监局”）出具的《关于对周洪亮采取出具警示函行政监管措施的决定》（[2021]49 号），认定周洪亮于 2021 年 1 月 4 日在公司业绩预增公告前 10 日减持，违反了《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》（证监公司字[2007]56 号）第十三条和《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（证监会公告[2017]9 号）第七条的规定，对周洪亮采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券市场诚信档案。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，恒润股份表示高度重视证监局指出的问题，公司全体高管吸取此次教训，加强对相关法律法规和规范性文件的学习，加强证券账户日常管理，严格规范买卖公司股票行为，杜绝此类情况再次发生。公司主营业务塔筒法兰受

益于风电新增装机容量的增长，属于单兆瓦价值量增长的少数零部件；同时风机轴承业务开拓顺利，未来几年贡献利润增量，当前估值较低，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恒润股份进行了投资。

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	存出保证金	55,058,019.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	436,750.32
5	应收申购款	428,136.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,922,906.24

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	244,877,827.35	217,262,274.12
报告期期间基金总申购份额	46,040,658.95	95,256,131.20
减：报告期期间基金总赎回份额	63,844,975.80	118,171,300.31
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	227,073,510.50	194,347,105.01

§ 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	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
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（%）	2.20	2.57

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	10,000,000.00	2.37	10,000,000.00	2.37	36 个月
基金管理人 高级管理人员	96.60	0.00	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,096.60	2.37	10,000,000.00	2.37	36 个月

§ 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

本基金本报告期末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

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 12 月 31 日，创金合信基金共管理 79 只公募基金，公募管理规模 829 亿元。

§ 10 备查文件目录

10.1 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 4 季度报告原文。

10.2 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

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日