

创金合信沪深 300 指数增强型发起式 证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 06 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 7 月 20 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.....	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名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名的前十名资产支持证券投资明 细.....	10
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.....	10
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.....	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	10
5.11 投资组合报告附注.....	11
§6 开放式基金份额变动.....	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	12
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	12
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
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.....	13
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§10 备查文件目录.....	13
10.1 备查文件目录.....	13
10.2 存放地点.....	13
10.3 查阅方式.....	14

§ 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的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 18 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信沪深 300 增强	
基金主代码	002310	
交易代码	002310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 31 日	
报告期末基金份额总额	261,834,195.74 份	
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。	
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C

下属分级基金的交易代码	002310	002315
报告期末下属分级基金的份额总额	100,674,540.66 份	161,159,655.08 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（2022 年 4 月 1 日—2022 年 6 月 30 日）	
	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
1.本期已实现收益	1,217,293.76	980,571.57
2.本期利润	10,642,362.11	17,225,407.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1041	0.0918
4.期末基金资产净值	154,223,759.72	246,441,430.27
5.期末基金份额净值	1.5319	1.5292

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

创金合信沪深 300 增强 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	6.99%	1.44%	5.95%	1.36%	1.04%	0.08%
过去六个月	-6.64%	1.44%	-8.69%	1.38%	2.05%	0.06%
过去一年	-11.86%	1.24%	-13.35%	1.18%	1.49%	0.06%
过去三年	47.55%	1.23%	16.90%	1.20%	30.65%	0.03%
过去五年	62.21%	1.20%	22.12%	1.21%	40.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	73.24%	1.19%	19.38%	1.19%	53.86%	0.00%

创金合信沪深 300 增强 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	6.97%	1.44%	5.95%	1.36%	1.02%	0.08%

过去六个月	-6.68%	1.44%	-8.69%	1.38%	2.01%	0.06%
过去一年	-11.94%	1.24%	-13.35%	1.18%	1.41%	0.06%
过去三年	47.01%	1.23%	16.90%	1.20%	30.11%	0.03%
过去五年	61.90%	1.20%	22.12%	1.21%	39.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	73.95%	1.19%	19.38%	1.19%	54.57%	0.00%

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



§ 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		
孙悦	本基金基金经理	2021 年 7 月 19 日	-	4	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，历任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席量化官兼任量化指数与国际部总监	2018 年 11 月 19 日	-	18	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学材料科学博士，2005 年 3 月加入美国巴克莱环球投资(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理,负责美股量化模型开发及投资工作。2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员,负责港股量化模型开发和投资,以及环球股指期货期权的量化投资。2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理,进行港股投资。2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司,任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015 年加入香港启智资产管理有限公司 (Zentific Investment Management) 任投资部基金经理。2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司,现任首席量化投资官,兼量化指数与国际部总监、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

2022 年二季度，国内外局势仍然复杂，但未出现更加超预期的大事件。海外方面，俄乌冲突仍然持续，但进程趋缓，给全球金融市场带来的影响逐渐下降。美国方面，通胀水平仍然处于高位，美联储继续采用加息的手段进行抑制，美股市场受到影响较大。国内方面，形势有较大好转，疫情得到了有效控制，企业陆续复工复产，一系列会议和稳增长政策提振了市场信心，股市走出独立行情。大类资产方面，原油价格持续上涨后高位震荡，美元指数上行，黄金下行，美股震荡下跌，A 股触底反弹。国内股市风格方面，成长风格经历大幅回落后，从 4 月底开始反弹。

2022 年二季度，沪深 300 指数触底反弹，行业间收益率分化比较明显。业绩基准指数成份股内，表现最好的几个行业是休闲服务 39.47%、汽车 32.16%、食品饮料 22.70%，表现最差的几个行业是商业贸易-9.72%、房地产-2.95%、计算机-2.93%。风格方面，成份股内成长因子表现较好，价值因子表现较差。

本基金以沪深 300 指数为基准，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制跟踪误差，在此基础上追求超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.5319 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.99%，同期业绩比较基准收益率为 5.95%；截至本报告期末创金合信沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.5292 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.97%，同期业绩比较基准收益率为 5.95%。

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	375,513,671.38	90.93
	其中：股票	375,513,671.38	90.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,417,821.97	3.01
	其中：债券	12,417,821.97	3.01
	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	22,092,202.12	5.35
8	其他资产	2,942,361.87	0.71
9	合计	412,966,057.34	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 18,201,142.00 元，占净值比为 4.54%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	549,273.26	0.14
B	采矿业	3,364,716.00	0.84
C	制造业	225,182,793.39	56.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,231,459.00	2.30
E	建筑业	4,772,054.00	1.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,356,396.00	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,161,570.00	2.79
J	金融业	71,552,554.20	17.86
K	房地产业	5,806,396.00	1.45
L	租赁和商务服务业	537,198.00	0.13

M	科学研究和技术服务业	5,758,758.22	1.44
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	344,273,168.07	85.93

5.2.2 报告期末积极投资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	4,579,506.64	1.14
C	制造业	13,864,954.06	3.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,618,811.00	0.65
F	批发和零售业	1,372,729.91	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,730,886.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,997,340.36	1.00
J	金融业	1,688,791.00	0.42
K	房地产业	705,900.00	0.18
L	租赁和商务服务业	12,404.91	0.00
M	科学研究和技术服务业	307,900.73	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	177,549.70	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	183,729.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,240,503.31	7.80

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	600519	贵州茅台	11,259	23,024,655.00	5.75
2	300750	宁德时代	34,500	18,423,000.00	4.60
3	601166	兴业银行	553,979	11,024,182.10	2.75
4	000333	美的集团	138,168	8,343,965.52	2.08
5	603392	万泰生物	46,095	7,158,553.50	1.79
6	300122	智飞生物	63,500	7,049,135.00	1.76
7	000977	浪潮信息	265,400	7,027,792.00	1.75
8	601211	国泰君安	442,900	6,732,080.00	1.68
9	300059	东方财富	264,440	6,716,776.00	1.68
10	002371	北方华创	23,600	6,540,032.00	1.63

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600563	法拉电子	26,500	5,436,740.00	1.36
2	002128	电投能源	226,760	3,247,203.20	0.81
3	600039	四川路桥	248,700	2,618,811.00	0.65
4	600131	国网信通	176,800	2,377,960.00	0.59
5	000617	中油资本	351,100	1,688,791.00	0.42

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	12,417,821.97	3.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	12,417,821.97	3.10

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	019666	22 国债 01	122,800	12,417,821.97	3.10

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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2209	IF2209	3	4,002,480.00	111,661.11	-
公允价值变动总额合计（元）					111,661.11
股指期货投资本期收益（元）					-115,505.55
股指期货投资本期公允价值变动（元）					60,887.97

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

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

2021 年 7 月 21 日，兴业银行股份有限公司（下称“兴业银行”，股票代码：601166.SH），收到国家外汇管理局福建分局行政处罚决定书（闽汇罚〔2021〕5 号），兴业银行因违规办理内保外贷业务、未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料、违反外汇市场交易管理规定等原因，违反《中华人民共和国外汇管理条例》第四十三条、第四十七条、第四十八条、第四十九条，被国家外汇管理局福建分局责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元。

2021 年 8 月 13 日，兴业银行收到中国人民银行行政处罚决定书（银罚字〔2021〕26 号），因其违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，违反《中华人民共和国中国人民银行法》，被中国人民银行罚款 5 万元。

2022 年 3 月 21 日，兴业银行收到行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕22 号），因标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会罚款 350 万元。

本基金投研人员分析认为，本基金是一只基于量化模型选股、运用优化器来建仓的基金。经过量化模型的综合评估，此事件的影响已经反映在股价之中，符合本基金的投资标准，依据基金合同和公司投资管理制度继续持有兴业银行。

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	798,892.05
2	应收证券清算款	1,827,114.49
3	应收股利	475.07
4	应收利息	-
5	应收申购款	308,370.80
6	其他应收款	7,509.46
7	其他	-
8	合计	2,942,361.87

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	300750	宁德时代	3,257,400.00	0.81	转融通证券出借
2	000333	美的集团	1,407,087.00	0.35	转融通证券出借
3	300122	智飞生物	1,132,302.00	0.28	转融通证券出借

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	600131	国网信通	379,290.00	0.09	转融通证券出借
2	600039	四川路桥	320,112.00	0.08	转融通证券出借

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信沪深 300 增强 A	创金合信沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	99,160,383.53	160,406,203.33
报告期期间基金总申购份额	9,388,154.88	50,277,167.95
减：报告期期间基金总赎回份额	7,873,997.75	49,523,716.20
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	100,674,540.66	161,159,655.08

§ 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 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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	1,222.19	0.00	-	-	-
基金经理等人员	58,120.03	0.02	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	59,342.22	0.02	0.00	0.00	-

§ 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

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 2022 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 84 只公募基金，公募管理规模 1027.19 亿元。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年 2 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 7 月 20 日