

# 创金合信鑫利混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 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.....	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.....	9
§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.....	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.....	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.....	10
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的法律责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信鑫利混合	
基金主代码	008893	
交易代码	008893	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 17 日	
报告期末基金份额总额	130,694,220.61 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法，并通过“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，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	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫利混合 A	创金合信鑫利混合 C
下属分级基金的交易代码	008893	008894
报告期末下属分级基金的份额总额	56,896,080.84 份	73,798,139.77 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（2023 年 4 月 1 日—2023 年 6 月 30 日）	
	创金合信鑫利混合 A	创金合信鑫利混合 C
1.本期已实现收益	566,585.29	902,315.87
2.本期利润	977,741.98	1,679,236.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0212	0.0200
4.期末基金资产净值	77,811,262.12	99,921,608.43
5.期末基金份额净值	1.3676	1.3540

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

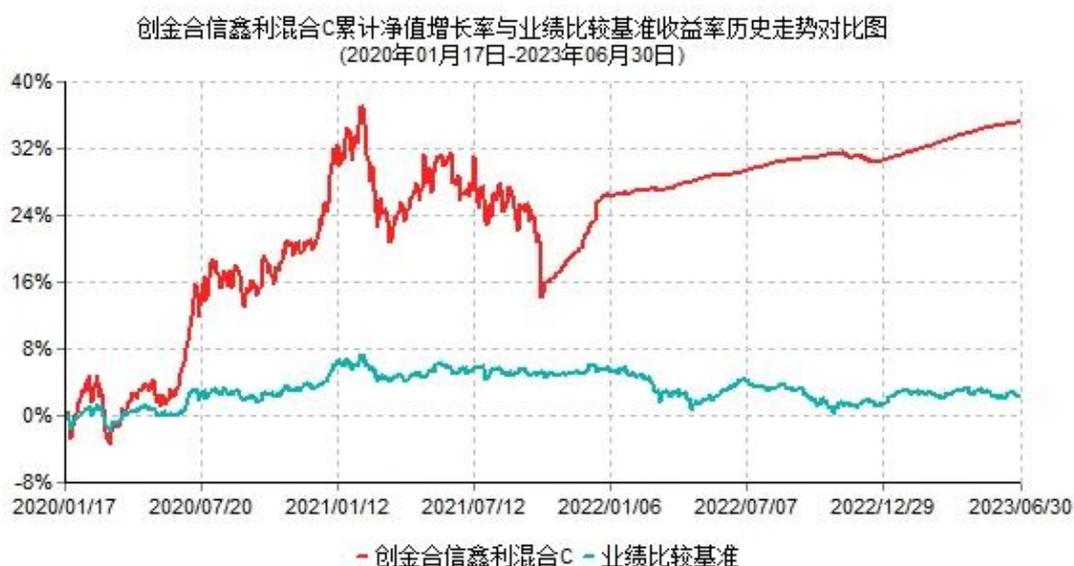
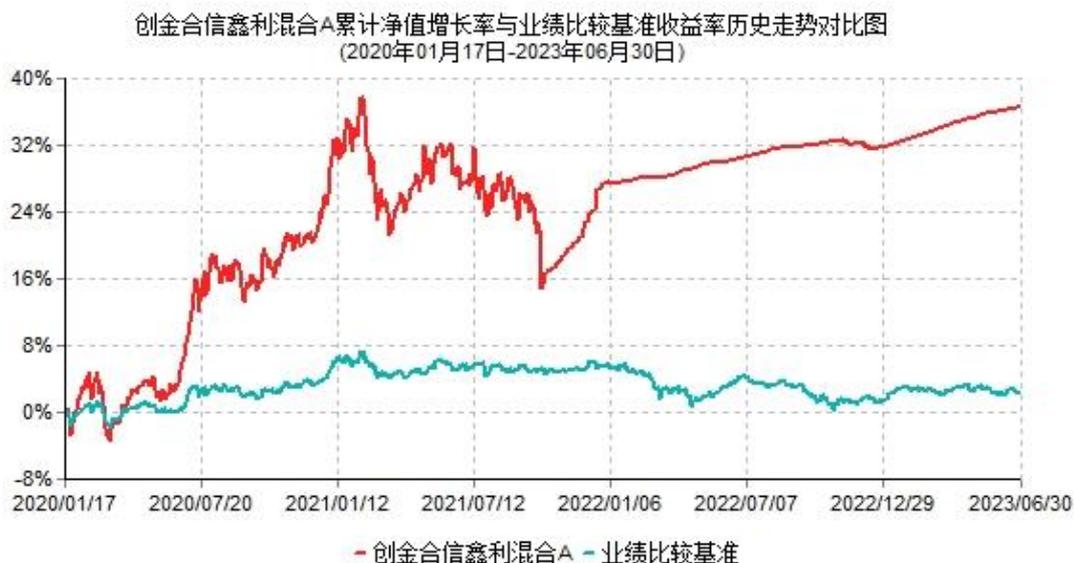
创金合信鑫利混合 A

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	1.54%	0.02%	-0.28%	0.16%	1.82%	-0.14%
过去六个月	3.71%	0.02%	0.89%	0.16%	2.82%	-0.14%
过去一年	4.80%	0.03%	-1.81%	0.19%	6.61%	-0.16%
过去三年	27.03%	0.61%	1.61%	0.24%	25.42%	0.37%
自基金合同生效起至今	36.76%	0.63%	2.44%	0.25%	34.32%	0.38%

创金合信鑫利混合 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	1.50%	0.02%	-0.28%	0.16%	1.78%	-0.14%
过去六个月	3.60%	0.02%	0.89%	0.16%	2.71%	-0.14%
过去一年	4.72%	0.03%	-1.81%	0.19%	6.53%	-0.16%
过去三年	25.99%	0.61%	1.61%	0.24%	24.38%	0.37%
自基金合同生效起至今	35.40%	0.63%	2.44%	0.25%	32.96%	0.38%

### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王一兵	本基金基金经理、固	2021年10月22日	-	19	王一兵先生, 中国国籍, 四川大学 MBA。曾任职于四川和正期货公司, 2009年3月加入第一创业证券股份有限公司, 历

	定收益部总监				任固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，现任固定收益部总监、基金经理。
闫一帆	本基金基金经理	2020 年 1 月 22 日	-	13	闫一帆先生，中国国籍，新加坡南洋理工大学硕士。2008 年 7 月加入国泰君安证券股份有限公司，任机构销售，2011 年 5 月加入永安财产保险股份有限公司，任投资管理中心固定收益研究员，2012 年 10 月加入第一创业证券股份有限公司，任资产管理部固定收益研究员，2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任投资经理、信用研究主管，现任固定收益部副总监、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

2023 年二季度债券市场总体利率继续下行，但 5 月之后，AAA 高等级信用债与中低等级信用债的表现有所分化。二季度债券市场的环境总体相对有利，一方面，一季度经济在生产快速恢复和消费激活的作用下，短期表现转好，不过上述短期效应消退后，消费增长重新回归到收入增长和消费意愿的运行逻辑。当前现状是居民收入增长相对缓慢，消费意愿有提升但对未来仍有顾虑，总体仍制约了消费恢复的力度。而从投资来看，在政策对房地产市场持续进行金融支持的环境下，房地产的销售、开工、投资都有所恢复，但程度并不强劲；基建投资保持个位数增长，相对稳健。综合来看，二季度经济表现相对不如一季度，短期经济压力有所加大。因此，6 月政策加大逆周期力量，货币政策进行了降息，同时国务院也出台相关刺激措施。债券市场在二季度 4-5 月整体利率下行后，在 6 月转为震荡。信用方面，5 月云南昆明等区域出现负面舆情，市场对弱区域城投的信用担忧有所提高，估值波动加大。中低等级信用债的信用利差呈现扩张状态。

本报告期内，本基金以中等评级信用债配置策略为主，注重票息收入。不过，基于城投信用分化加大的趋势，未来将缩减对原持有区域的城投债配置比例，提升对经济实力更强区域的配置比例，同时适当增加 AAA 高评级债券的交易，减少信用风险暴露和估值波动风险，提升组合整体稳健性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫利混合 A 基金份额净值为 1.3676 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.54%，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鑫利混合 C 基金份额净值为 1.3540 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.50%，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	182,620,907.68	93.73
	其中：债券	182,620,907.68	93.73
	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	8,991,095.89	4.61
	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	3,216,515.89	1.65
8	其他资产	1,342.68	0.00
9	合计	194,829,862.14	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	31,447,226.57	17.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,707,997.53	7.15
5	企业短期融资券	25,630,247.93	14.42
6	中期票据	112,835,435.65	63.49
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	182,620,907.68	102.75

## 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	019694	23 国债 01	160,000	16,177,543.01	9.10
2	102102191	21 北部湾 MTN006	150,000	15,696,715.07	8.83
3	042280337	22 广西旅发 CP001	150,000	15,487,641.37	8.71
4	019679	22 国债 14	150,000	15,269,683.56	8.59
5	102101203	21 威宁投资 MTN002	150,000	15,137,139.34	8.52

## 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，钦州市开发投资集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到钦州市城市管理行政执法局处罚的情况；钦州市滨海新城投资集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到钦州市城市管理行政执法局处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 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	1,342.68
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,342.68

### 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	创金合信鑫利混合 A	创金合信鑫利混合 C
报告期期初基金份额总额	45,927,680.03	87,766,805.21
报告期期间基金总申购份额	10,981,328.79	10,977,399.74
减：报告期期间基金总赎回份额	12,927.98	24,946,065.18

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	56,896,080.84	73,798,139.77

## § 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。

### 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。2022 年 7 月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。截至 2023 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 95 只公募基金，公募管理规模 1161.93 亿元。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫利混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫利混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫利混合型证券投资基金 2023 年 2 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](http://www.cjxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2023 年 7 月 20 日