

创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型 证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 1 月 19 日

目录

§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.....	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.....	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.....	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.....	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.....	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 2024 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信季安鑫 3 个月	
基金主代码	002337	
交易代码	002337	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 9 日	
报告期末基金份额总额	994,315,076.37 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。	
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，本基金将投资组合的平均久期控制在 2 年以内，力争实现基金资产的稳健增值。	
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
下属分级基金的交易代码	002337	009459
报告期末下属分级基金的份额总额	10,612,094.83 份	983,702,981.54 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 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日）	
	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
1. 本期已实现收益	296,537.45	7,406,058.75
2. 本期利润	335,707.29	9,963,268.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0102
4. 期末基金资产净值	12,053,589.33	1,108,548,325.75
5. 期末基金份额净值	1.1358	1.1269

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

创金合信季安鑫 3 个月 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	0.95%	0.02%	0.71%	0.03%	0.24%	-0.01%
过去六个月	1.66%	0.02%	1.12%	0.03%	0.54%	-0.01%
过去一年	3.73%	0.02%	2.61%	0.02%	1.12%	0.00%
过去三年	12.58%	0.02%	8.60%	0.03%	3.98%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.58%	0.03%	9.63%	0.03%	3.95%	0.00%

创金合信季安鑫 3 个月 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	0.91%	0.02%	0.71%	0.03%	0.20%	-0.01%
过去六个月	1.57%	0.02%	1.12%	0.03%	0.45%	-0.01%
过去一年	3.53%	0.02%	2.61%	0.02%	0.92%	0.00%
过去三年	11.83%	0.02%	8.60%	0.03%	3.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.69%	0.03%	9.63%	0.03%	3.06%	0.00%

3.2.2 自基金转型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		
黄佳祥	本基金	2021年2月	-	6	黄佳祥先生，中国国籍，厦门大学博士。

	基金经 理	月3日			2017年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，现任基金经理。
王一兵	本基金 基金经 理、固 定收益 总部总 监	2020年6 月9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，现任固定收益总部总监、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

2023 年四季度，债券市场呈现先横盘后下行的“M”型态势，曲线结构向平坦化的形态演绎。进入 10 月份，特殊再融资债供给扰动叠加人民币汇率压力导致资金面持续紧平衡，收益率持续上行，短端利率上行幅度相对于长端更大。市场不断对积极财政政策等宽信用政策定价，10 年国债上行至 2.7%左右的高位，随着 10 月 24 日人大常委会审议批准增发 1 万亿特别国债和赤字率上调至 3.8%的水平等信息兑现落地，市场定价利空出尽，长端利率高位回落，在该点位市场表现出较强的配置需求。进入 11 月，PMI 和通胀等数据转弱指向需求偏弱，叠加资金面边际转松，债市迎来修复，随后在大行缺流动性指标以及资本新规对货币基金负债端的扰动影响下，同业存单收益率持续上行，叠加 12 月政治局会议和中央经济工作会议的不确定性，长端收益率上行至前期的高位。三季度货币政策执行报告提及的“更多关注存量贷款的持续效用”，11 月 PMI 仍处于荣枯线以下，市场对于偏紧的资金面定价已经非常充分，债市收益率具有较好的赔率，12 月中上旬中央经济工作会议内容未超预期，市场对于积极的稳增长政策担忧基本解除，12 月下旬存款利率下调进一步推动债券收益率下行。往后看，未来一季度前期处于数据真空期，仍然处于经济基本面偏弱的阶段，在 2023 年四季度长端流动性的投放下，流动性的总量处于偏宽裕的状态，货币的环境会决定一季度债券市场演绎的节奏，当前短端资产定价处于中性偏高的位置，一季度前期组合久期和杠杆处于中性偏高的水平，长端资产仍有博弈降息的空间。如果一季度未降息，市场可能会有一定调整，但调整的空间不会太大，进入 2024 年一季度末扰动因素可能会增多，包括两会召开以及资本新规实施对机构行为影响的不确定性。在组合操作方面，维持组合策略灵活性的基础上，精选具有信用利差的品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信季安鑫 3 个月 A 基金份额净值为 1.1358 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；截至本报告期末创金合信季安鑫 3 个月 C 基金份额净值为 1.1269 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.91%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

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	1,154,935,658.00	93.46
	其中：债券	1,154,935,658.00	93.46
	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	70,087,142.46	5.67
	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	3,430,706.88	0.28
8	其他资产	7,237,767.72	0.59
9	合计	1,235,691,275.06	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	352,981,058.49	31.50
	其中：政策性金融债	240,089,923.50	21.43
4	企业债券	416,413,425.24	37.16
5	企业短期融资券	71,777,732.38	6.41
6	中期票据	204,709,094.29	18.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	109,054,347.60	9.73

9	其他	-	-
10	合计	1,154,935,658.00	103.06

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	092218003	22 农发清发 03	1,280,000	129,668,196.72	11.57
2	092218005	22 农发清发 05	1,100,000	110,421,726.78	9.85
3	2020068	20 海峡银行二级 01	300,000	30,985,311.48	2.77
4	1980231	19 莆田高新债	470,000	29,372,685.44	2.62
5	102100324	21 镇江城建 MTN002	200,000	21,060,797.81	1.88

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

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，福建海峡银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局(原中国银行保险监督管理委员会福建监管局)处罚的情况；淮安市清江浦融合投资控股集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到淮安市自然资源和规划局处罚的情况。

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

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	6,224.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,231,543.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,237,767.72

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	创金合信季安鑫 3 个月 A	创金合信季安鑫 3 个月 C
报告期期初基金份额总额	46,532,111.08	981,813,228.78
报告期期间基金总申购份额	1,390,291.98	163,472,286.42
减：报告期期间基金总赎回份额	37,310,308.23	161,582,533.66
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	10,612,094.83	983,702,981.54

§ 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。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 12 月 31 日，创金合信基金共管理 100 只公募基金，公募管理规模 1188.70 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信季安鑫 3 个月持有期债券型证券投资基金 2023 年 4 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

2024 年 1 月 19 日