

创金合信鑫瑞混合型证券投资基金 2024年第2季度报告

2024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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2024年7月18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.....	5
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.....	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.....	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.....	9
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.....	9
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.....	10
§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.....	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
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.....	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§9 备查文件目录.....	13
9.1 备查文件目录.....	13
9.2 存放地点.....	14
9.3 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信鑫瑞混合
基金主代码	011442
交易代码	011442
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	56,466,550.29 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。 在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等，以判断经济波动对市场的影响；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；（3）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，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	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫瑞混合 A	创金合信鑫瑞混合 C
下属分级基金的交易代码	011442	011443
报告期末下属分级基金的份 额总额	14,537,730.86 份	41,928,819.43 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（2024 年 4 月 1 日—2024 年 6 月 30 日）	
	创金合信鑫瑞混合 A	创金合信鑫瑞混合 C
1.本期已实现收益	-10,657.99	-39,597.13
2.本期利润	-77,431.88	114,964.99
3.加权平均基金份额本期利 润	-0.0087	0.0022
4.期末基金资产净值	15,188,098.88	43,279,481.32
5.期末基金份额净值	1.0447	1.0322

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

创金合信鑫瑞混合 A

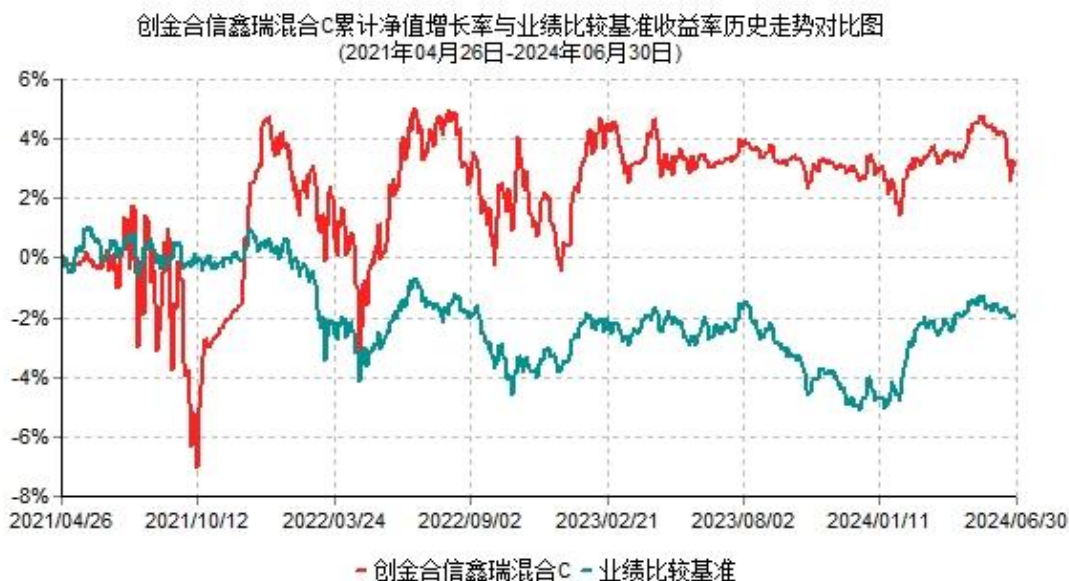
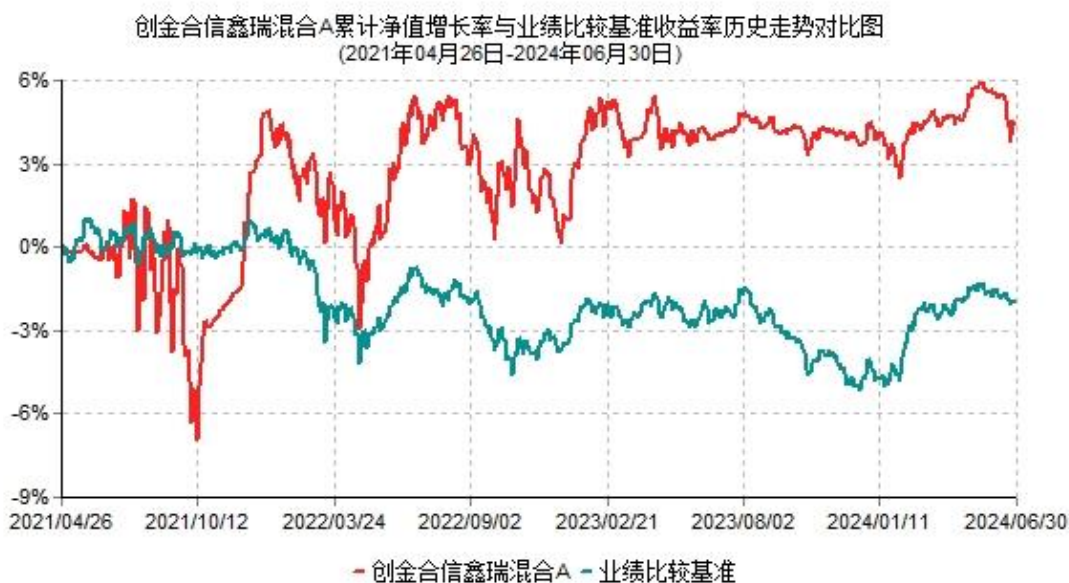
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.16%	0.44%	0.14%	-0.44%	0.02%
过去六个月	0.01%	0.18%	2.19%	0.17%	-2.18%	0.01%
过去一年	0.50%	0.15%	0.64%	0.17%	-0.14%	-0.02%
过去三年	4.51%	0.47%	-2.45%	0.21%	6.96%	0.26%
自基金合同 生效起至今	4.47%	0.46%	-1.91%	0.21%	6.38%	0.25%

创金合信鑫瑞混合 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④
----	--------------	----------------	----------------	----------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-0.10%	0.16%	0.44%	0.14%	-0.54%	0.02%
过去六个月	-0.18%	0.18%	2.19%	0.17%	-2.37%	0.01%
过去一年	0.10%	0.15%	0.64%	0.17%	-0.54%	-0.02%
过去三年	3.21%	0.47%	-2.45%	0.21%	5.66%	0.26%
自基金合同生效起至今	3.22%	0.46%	-1.91%	0.21%	5.13%	0.25%

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		
黄浩东	本基金基金经理、固收投资部总监助理	2023 年 5 月 12 日	-	12	黄浩东先生，中国国籍，清华大学硕士。2008 年 7 月加入广西玉柴机器集团有限公司，任投融资部投资经理，2010 年 4 月加入天华阳光电力有限公司，任财务部财务经理，2011 年 7 月加入东莞证券股份有限公司深圳分公司，任固定收益部经理、深圳分公司副总经理，2019 年 8 月加入新疆前海联合基金有限公司，任固定收益部总经理、基金经理，2022 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司，现任固收投资部总监助理、基金经理。
王一兵	本基金基金经理、总经理助理	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，曾任固定收益总部总监，现任总经理助理、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

在国内经济方面，经济总体企稳，但房地产市场仍显疲态，销售数据未能有效提振，居民消费需求也呈现出较弱的态势。通胀水平则相对稳定，保持在低位运行。与此同时，出口和制造业投资成为亮点，表现相对强劲，为经济增长提供了有力支撑。国际市场看，美国经济总体保持强劲，就业市场表现良好，但核心通胀水平依然偏高，引发市场关注。美联储在此背景下，尚未采取降息措施，货币政策保持谨慎。在货币政策层面，国内上半年整体保持平稳，未出现明显的流动性分层现象，为市场提供了稳定的金融环境。权益市场方面，上半年呈现出显著的分化特征。上证指数虽略有下跌，但整体波动不大，而大部分指数则出现半年度收跌，全 A 指数更是跌幅接近 20%。值得注意的是，资源、电力等红利版块成为市场上涨的主要动力。转债市场方面，由于其发行主体多集中于中证 1000 和中证 2000 的成分股，上半年中小市值股票的承压也直接影响了转债市场的表现。受流动性、信用评级以及面值退市等多重因素影响，转债市场经历了三次较大的下跌。尽管中证转债指数上半年基本持平，但转债市场的算术平均跌幅仍超过了 5%，显示出市场的波动性和挑战。

在报告期内，产品保持了较低股票仓位和中等转债仓位，债券主要以城投债和券商信用债券为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫瑞混合 A 基金份额净值为 1.0447 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；截至本报告期末创金合信鑫瑞混合 C 基金份额净值为 1.0322 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%。

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	2,728,140.50	4.56
	其中：股票	2,728,140.50	4.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,435,109.86	90.93
	其中：债券	54,435,109.86	90.93
	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	667,258.13	1.11
8	其他资产	2,033,272.34	3.40
9	合计	59,863,780.83	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,350,680.50	4.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	71,380.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	109,380.00	0.19
K	房地产业	140,490.00	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	56,210.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	2,728,140.50	4.67

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	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.25
2	300633	开立医疗	3,500	138,530.00	0.24
3	600486	扬农化工	2,050	115,722.50	0.20
4	002179	中航光电	3,000	114,150.00	0.20
5	603816	顾家家居	3,500	113,015.00	0.19
6	600030	中信证券	6,000	109,380.00	0.19
7	300124	汇川技术	2,100	107,730.00	0.18
8	002572	索菲亚	7,000	107,310.00	0.18
9	002126	银轮股份	6,000	104,460.00	0.18
10	002032	苏泊尔	2,000	100,200.00	0.17

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	3,665,485.48	6.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,592,732.57	6.14
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,210,417.13	14.04
5	企业短期融资券	20,340,151.37	34.79
6	中期票据	308,015.70	0.53
7	可转债（可交换债）	18,318,307.61	31.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,435,109.86	93.10

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	019727	23 国债 24	36,000	3,665,485.48	6.27
2	042300057	23 邹城资产 CP001	30,000	3,202,539.34	5.48
3	012480562	24 昆山创业 SCP001	30,000	3,028,578.69	5.18
4	012480764	24 建安投资 SCP001	30,000	3,025,947.95	5.18
5	012480578	24 珠海港 SCP003	30,000	3,025,572.79	5.17

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，扬州瘦西湖旅游发展集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到扬州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

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	7,396.99
2	应收清算款	2,000,327.12
3	应收股利	-
4	应收利息	15,596.00
5	应收申购款	9,952.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,033,272.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127022	恒逸转债	1,942,167.35	3.32
2	118031	天 23 转债	1,207,066.03	2.06
3	113053	隆 22 转债	712,252.49	1.22
4	127018	本钢转债	590,383.29	1.01
5	110070	凌钢转债	421,825.21	0.72
6	127030	盛虹转债	375,557.19	0.64
7	110095	双良转债	362,535.04	0.62
8	128116	瑞达转债	351,009.73	0.60
9	128134	鸿路转债	321,273.70	0.55

10	110085	通 22 转债	317,301.04	0.54
11	127067	恒逸转 2	316,670.55	0.54
12	113641	华友转债	304,401.04	0.52
13	118022	锂科转债	297,624.66	0.51
14	118034	晶能转债	292,869.37	0.50
15	127089	晶澳转债	291,907.64	0.50
16	113037	紫银转债	279,998.17	0.48
17	118024	冠宇转债	278,521.09	0.48
18	113047	旗滨转债	274,129.79	0.47
19	127066	科利转债	272,730.82	0.47
20	113670	金 23 转债	267,905.48	0.46
21	123149	通裕转债	252,460.27	0.43
22	113050	南银转债	250,824.16	0.43
23	113623	凤 21 转债	247,692.33	0.42
24	123145	药石转债	232,055.51	0.40
25	123104	卫宁转债	229,563.56	0.39
26	113652	伟 22 转债	226,223.18	0.39
27	113064	东材转债	224,897.53	0.38
28	123091	长海转债	224,189.32	0.38
29	113655	欧 22 转债	221,423.87	0.38
30	113059	福莱转债	213,624.11	0.37
31	128129	青农转债	212,850.68	0.36
32	127046	百润转债	205,585.21	0.35
33	110087	天业转债	202,361.04	0.35
34	110073	国投转债	187,254.63	0.32
35	128128	齐翔转 2	184,883.42	0.32
36	127017	万青转债	177,140.38	0.30
37	127016	鲁泰转债	175,549.05	0.30
38	113666	爱玛转债	171,195.41	0.29
39	110089	兴发转债	168,568.56	0.29
40	127026	超声转债	167,720.96	0.29
41	128109	楚江转债	166,239.78	0.28
42	110093	神马转债	165,755.71	0.28
43	113584	家悦转债	159,303.86	0.27
44	113046	金田转债	156,198.08	0.27
45	127025	冀东转债	155,228.96	0.27
46	113033	利群转债	152,488.52	0.26
47	113632	鹤 21 转债	141,606.41	0.24
48	113661	福 22 转债	138,261.91	0.24
49	113049	长汽转债	134,168.19	0.23
50	123101	拓斯转债	125,311.51	0.21
51	113062	常银转债	122,353.37	0.21
52	123119	康泰转 2	115,509.32	0.20

53	123035	利德转债	115,003.45	0.20
54	113638	台 21 转债	114,335.15	0.20
55	113065	齐鲁转债	113,997.62	0.19
56	113605	大参转债	113,800.00	0.19
57	127040	国泰转债	113,502.11	0.19
58	123117	健帆转债	113,446.30	0.19
59	127052	西子转债	113,014.25	0.19
60	127073	天赐转债	112,147.95	0.19
61	127024	盈峰转债	110,932.38	0.19
62	113058	友发转债	110,013.84	0.19
63	127056	中特转债	109,338.55	0.19
64	123208	孩王转债	108,304.88	0.19
65	113579	健友转债	108,152.22	0.18
66	128130	景兴转债	107,839.45	0.18
67	113633	科沃转债	106,746.85	0.18
68	127042	嘉美转债	105,614.52	0.18
69	110081	闻泰转债	99,102.25	0.17
70	128144	利民转债	98,357.40	0.17
71	123107	温氏转债	63,099.52	0.11
72	128131	崇达转 2	60,954.54	0.10
73	110079	杭银转债	60,383.62	0.10
74	118030	睿创转债	58,676.59	0.10
75	128132	交建转债	58,220.07	0.10
76	123216	科顺转债	57,220.59	0.10
77	113659	莱克转债	56,082.47	0.10
78	113532	海环转债	55,692.26	0.10
79	111010	立昂转债	55,335.48	0.09
80	127085	韵达转债	55,050.51	0.09
81	113516	苏农转债	54,989.86	0.09
82	123064	万孚转债	54,958.08	0.09
83	113627	太平转债	54,004.66	0.09
84	127049	希望转 2	51,751.29	0.09
85	111009	盛泰转债	47,729.32	0.08
86	128141	旺能转债	34,357.32	0.06
87	113043	财通转债	32,234.93	0.06

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	创金合信鑫瑞混合 A	创金合信鑫瑞混合 C
报告期期初基金份额总额	3,641,989.26	50,278,464.91
报告期期间基金总申购份额	11,078,188.88	20,799,019.61
减：报告期期间基金总赎回份额	182,447.28	29,148,665.09
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	14,537,730.86	41,928,819.43

§ 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，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 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心，倡导合伙文化，致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 6 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1615.63 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫瑞混合型证券投资基金托管协议》；

3、创金合信鑫瑞混合型证券投资基金 2024 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

创金合信基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日