

创金合信转债精选债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 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：2024 年 10 月 24 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.....	5
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.....	6
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.....	7
§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.....	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.....	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.....	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	11
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.....	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
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.....	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
§9 备查文件目录.....	13
9.1 备查文件目录.....	13
9.2 存放地点.....	13
9.3 查阅方式.....	13

§ 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 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信转债精选债券
基金主代码	002101
交易代码	002101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 15 日
报告期末基金份额总额	45,439,073.48 份
投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转换债券为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增加值、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）进行分析，预测未来的利率趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极的投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。
业绩比较基准	中证可转换债券指数*90%+中证全债指数*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
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	创金合信转债精选债券 A	创金合信转债精选债券 C
下属分级基金的交易代码	002101	002102
报告期末下属分级基金的份额总额	28,745,523.03 份	16,693,550.45 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 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日）	
	创金合信转债精选债券 A	创金合信转债精选债券 C
1. 本期已实现收益	-438,989.75	-334,792.16
2. 本期利润	461,288.91	772,677.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0620	0.0855
4. 期末基金资产净值	34,499,273.76	19,654,786.08
5. 期末基金份额净值	1.2002	1.1774

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

创金合信转债精选债券 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	0.49%	0.66%	0.66%	0.61%	-0.17%	0.05%
过去六个月	-1.06%	0.66%	1.54%	0.52%	-2.60%	0.14%
过去一年	-7.16%	0.60%	-1.75%	0.47%	-5.41%	0.13%
过去三年	-5.59%	0.57%	-1.70%	0.48%	-3.89%	0.09%
过去五年	9.83%	0.57%	20.58%	0.52%	-	0.05%
自基金合同生效起至今	19.63%	0.59%	38.63%	0.54%	-	0.05%

创金合信转债精选债券 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	0.49%	0.66%	0.66%	0.61%	-0.17%	0.05%
过去六个月	-1.06%	0.66%	1.54%	0.52%	-2.60%	0.14%
过去一年	-7.16%	0.60%	-1.75%	0.47%	-5.41%	0.13%
过去三年	-5.59%	0.57%	-1.70%	0.48%	-3.89%	0.09%
过去五年	9.83%	0.57%	20.58%	0.52%	-	0.05%
自基金合同生效起至今	19.63%	0.59%	38.63%	0.54%	-	0.05%

		②		准差④		
过去三个月	0.41%	0.66%	0.66%	0.61%	-0.25%	0.05%
过去六个月	-1.22%	0.66%	1.54%	0.52%	-2.76%	0.14%
过去一年	-7.47%	0.60%	-1.75%	0.47%	-5.72%	0.13%
过去三年	-6.47%	0.57%	-1.70%	0.48%	-4.77%	0.09%
过去五年	8.18%	0.57%	20.58%	0.52%	- 12.40%	0.05%
自基金合同 生效起至今	17.34%	0.59%	38.63%	0.54%	- 21.29%	0.05%

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

创金合信转债精选债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年08月15日-2024年09月30日)



创金合信转债精选债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年08月15日-2024年09月30日)



§ 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	-	13	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、兼任投资经理。
王一兵	本基金基金经理、总经理助理	2022 年 12 月 9 日	-	20	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

回顾三季度，经济基本上，三季度经济延续缓慢修复的态势，经济结构上，外需、制造业投资和基建投资保持增长，但消费、通胀继续存在压力，三季度对全年经济实现 5% 左右增长的支撑力度比较小。货币政策方面，继续宽松支持态势，降准和降息落地有望提振总需求。

三季度债市呈现慢涨急跌的形态，交易主线是监管调控力度，季度内出现过数次债市收益率快速上行，其中 7-8 月均为调控措施阶段，9 月底则是因为宏观政策出现较大的调整。但在基本面偏弱和货币宽松政策支持的情形下，债市其他时间处于缓慢上涨的阶段。

权益市场则在 9 月底之前延续下行趋势，随后在 9 月 24 日三部委新闻发布会及政治局会议公布了一系列超预期政策后，市场风险偏好大幅提升，股市大幅上涨。

三季度，转债市场紧随权益市场经历了显著的反转行情，下行压力因此得到有效缓解。具体而言，9 月中旬之前，转债市场表现疲软，这主要归因于基本面不振、权益市场低迷，以及诸如广汇退市、岭南违约等突发事件的冲击，这些因素共同导致了市场成交量的萎缩和价格的下行。随着政策支持力度大幅度增加，正股价格有较大修复，转债出现比较大的修复，风险得到了较好的缓释。

组合三季度以高仓位投资转债，转债类型较为丰富，偏股型，偏债型和平衡型均有配置，主要根据转债市场当前的转债分布比例增强配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信转债精选债券 A 基金份额净值为 1.2002 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.66%；截至本报告期末创金合

信转债精选债券 C 基金份额净值为 1.1774 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.66%。

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，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

自 2024 年 6 月 14 日至 2024 年 9 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§ 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	49,262,014.18	65.91
	其中：债券	49,262,014.18	65.91
	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	20,430,797.75	27.33
8	其他资产	5,051,741.93	6.76
9	合计	74,744,553.86	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	2,740,395.26	5.06
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）	46,521,618.92	85.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,262,014.18	90.97

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	13,000	1,328,713.97	2.45
2	019740	24 国债 09	13,000	1,310,174.19	2.42
3	123184	天阳转债	9,770	1,270,083.67	2.35
4	110067	华安转债	10,090	1,228,229.44	2.27
5	123191	智尚转债	10,210	1,212,667.71	2.24

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，安徽楚江科技新材料股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到芜湖市市场监管局处罚的情况。

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	1,172.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	5,050,569.56
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,051,741.93

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	123184	天阳转债	1,270,083.67	2.35
2	110067	华安转债	1,228,229.44	2.27
3	123191	智尚转债	1,212,667.71	2.24
4	123100	朗科转债	1,197,440.38	2.21
5	128109	楚江转债	1,197,140.44	2.21
6	123120	隆华转债	1,195,283.35	2.21
7	123150	九强转债	1,193,724.86	2.20
8	123119	康泰转 2	1,190,516.35	2.20
9	113563	柳药转债	1,186,405.45	2.19
10	118013	道通转债	1,184,053.83	2.19
11	111015	东亚转债	1,183,398.29	2.19
12	113659	莱克转债	1,183,180.16	2.18
13	123115	捷捷转债	1,181,123.73	2.18
14	127102	浙建转债	1,179,450.14	2.18
15	123240	楚天转债	1,174,618.62	2.17
16	113068	金铜转债	1,172,852.30	2.17
17	127052	西子转债	1,169,229.63	2.16
18	127031	洋丰转债	1,168,468.16	2.16
19	113638	台 21 转债	1,168,231.64	2.16
20	123090	三诺转债	1,167,395.81	2.16
21	113644	艾迪转债	1,167,160.40	2.16
22	128105	长集转债	1,166,900.43	2.15
23	113052	兴业转债	1,163,552.52	2.15
24	110062	烽火转债	1,157,789.67	2.14
25	127016	鲁泰转债	1,154,364.07	2.13
26	113623	凤 21 转债	1,153,613.91	2.13
27	127083	山路转债	1,151,675.33	2.13
28	113056	重银转债	1,145,416.25	2.12
29	128136	立讯转债	1,144,958.06	2.11
30	110059	浦发转债	1,141,349.49	2.11
31	128129	青农转债	1,138,885.52	2.10
32	123217	富仕转债	1,130,304.84	2.09
33	113037	紫银转债	1,125,259.84	2.08

34	113033	利群转债	1,124,042.65	2.08
35	110089	兴发转债	1,120,289.23	2.07
36	127049	希望转 2	1,111,218.72	2.05
37	127015	希望转债	1,089,723.59	2.01
38	123170	南电转债	658,252.86	1.22
39	113662	豪能转债	624,794.99	1.15
40	113673	岱美转债	622,772.66	1.15
41	127092	运机转债	436,836.70	0.81
42	127043	川恒转债	428,443.06	0.79
43	111017	蓝天转债	418,169.14	0.77
44	127037	银轮转债	142,351.03	0.26

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	创金合信转债精选债券 A	创金合信转债精选债券 C
报告期期初基金份额总额	7,452,588.62	36,359,259.69
报告期期间基金总申购份额	21,343,883.86	13,537,963.90
减：报告期期间基金总赎回份额	50,949.45	33,203,673.14
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	28,745,523.03	16,693,550.45

§ 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	创金合信转债精选债券 A	创金合信转债精选债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	746,006.67	4,644,775.90
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	746,006.67	4,644,775.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.60	27.82

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240701 - 20240930	11,179,575.67	0.00	0.00	11,179,575.67	24.60%
机构	2	20240911 - 20240929	0.00	9,021,902.83	0.00	9,021,902.83	19.85%
机构	3	20240930 - 20240930	0.00	16,935,388.26	0.00	16,935,388.26	37.27%
个人	1	20240701 - 20240702	15,650,389.12	0.00	15,650,389.12	0.00	0.00%
个人	2	20240701 - 20240702	15,393,825.37	0.00	15,393,825.37	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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 9 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1646.07 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信转债精选债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信转债精选债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信转债精选债券型证券投资基金 2024 年 3 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 10 月 24 日