

# 创金合信鼎诚 3 个月定期开放混合型 证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 月 02 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：2021 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.....	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.....	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.....	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.....	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.....	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
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.....	11
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
§9 备查文件目录.....	12
9.1 备查文件目录.....	12
9.2 存放地点.....	12
9.3 查阅方式.....	12

## § 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 2021 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 2 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信鼎诚 3 个月定开混合	
基金主代码	010100	
交易代码	010100	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 15 日	
报告期末基金份额总额	110,131,550.33 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	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。	
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	创金合信鼎诚 3 个月定开混合 A	创金合信鼎诚 3 个月定开混合 C
下属分级基金的交易代码	010100	010101
报告期末下属分级基金的份	110,119,591.54 份	11,958.79 份

额总额		
-----	--	--

### § 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（2021 年 4 月 1 日—2021 年 6 月 2 日）	
	创金合信鼎诚 3 个月定开混合 A	创金合信鼎诚 3 个月定开混合 C
1.本期已实现收益	1,400,577.12	8,275.69
2.本期利润	4,076,176.12	19,755.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0276
4.期末基金资产净值	119,598,913.11	12,958.82
5.期末基金份额净值	1.0861	1.0836

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

创金合信鼎诚 3 个月定开混合 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	1.99%	0.30%	1.37%	0.21%	0.62%	0.09%
过去六个月	4.62%	0.26%	1.01%	0.28%	3.61%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.61%	0.26%	3.89%	0.25%	4.72%	0.01%

创金合信鼎诚 3 个月定开混合 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	1.97%	0.30%	1.37%	0.21%	0.60%	0.09%

过去六个月	4.49%	0.26%	1.01%	0.28%	3.48%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.36%	0.26%	3.89%	0.25%	4.47%	0.01%

### 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



注：1、本基金合同于 2020 年 9 月 15 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。  
2、本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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		
吕沂洋	本基金基金经理（已离任）	2020年9月24日	2021年6月2日	6	吕沂洋先生，中国国籍，中山大学金融学硕士，2015年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部投资顾问，现任基金经理。
黄弢	本基金基金经理、权益投研总部执行总监、风格策略投资部和稳健收益投资部总监（已离任）	2020年9月15日	2021年6月2日	18	黄弢先生，中国国籍，清华大学法学硕士，2002年7月加入长城基金管理有限公司，任市场部渠道主管，2005年11月加入海富通基金管理有限公司，任市场部南方区总经理、2008年2月加入深圳市鼎诺投资管理有限公司，任公司执行总裁，2017年5月加入北京和聚投资管理有限公司任首席策略师，2018年4月加入上海禾驹投资管理中心（有限合伙），任首席策略师，2020年2月加入创金合信基金管理有限公司，现任权益投研总部执行总监、兼任风格策略投资部和稳健收益投资部总监、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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

## 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

2021 年二季度宏观经济延续恢复节奏，继续向潜在增速靠拢；结构表现仍保持分化、冷热不均，未有过热的风险，其中房地产市场和外需产业链保持较高景气度，消费则受疫情影响离完全恢复仍有距离。通胀仍是结构性特征，CPI 受猪价大跌带动下行，核心 CPI 恢复但总体低位；国内外需求总体旺盛和供给约束双重作用下，PPI 快速上涨，但向 CPI 传导尚不显著。政策方面，基于通胀的结构特征和支持经济继续恢复，二季度央行维持“稳”字当头基调，货币市场利率维持低位，7 天 DR007 利率维持在 2.2% 附近小幅波动，流动性总体维持偏宽松状态。债券市场方面，在偏宽松流动性的支撑下，二季度债市维持偏牛格局，仅在季末市场对资金面波动预期有 10bp 的小幅上行。市场曲线呈现牛陡特征，信用利差压缩；利率债及高评级品种绝对利率和利差水平处于历史相对低位，相比之下，中低等级品种因市场信用风险偏好回归缓慢，维持相对较高利差，配置价值相对较优，但需要注意防范信用风险、精选个券。

报告期内，债券部分，本基金结合当前及未来宏观政策形势变化的判断，灵活调整组合久期水平，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报；另外，二季度末，管理人结合组合情况进行了资产变现。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鼎诚 3 个月定开混合 A 基金份额净值为 1.0861 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；截至本报告期末创金合信鼎诚 3 个月定开混合 C 基金份额净值为 1.0836 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%。

#### 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	19,206,937.14	16.03
	其中：股票	19,206,937.14	16.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	73,175,875.80	61.08
	其中：债券	73,175,875.80	61.08
	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	25,858,745.93	21.58
8	其他资产	1,569,207.89	1.31
9	合计	119,810,766.76	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	12,349,418.44	10.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,252.75	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,470.74	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	169,410.15	0.14
J	金融业	6,569,649.00	5.49
K	房地产业	10,697.67	0.01
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	57,038.39	0.05
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	19,206,937.14	16.06

### 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	002532	天山铝业	916,030	9,664,116.50	8.08
2	601318	中国平安	92,700	6,569,649.00	5.49
3	600585	海螺水泥	30,400	1,469,840.00	1.23
4	688183	生益电子	17,740	247,473.00	0.21
5	300911	亿田智能	3,083	200,117.53	0.17
6	688619	罗普特	5,856	155,886.72	0.13
7	688656	浩欧博	1,371	113,930.10	0.10
8	300950	德固特	2,186	92,049.25	0.08
9	688678	福立旺	4,198	89,879.18	0.08
10	300919	中伟股份	610	83,942.10	0.07

### 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	73,175,875.80	61.18
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	73,175,875.80	61.18

### 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	019640	20 国债 10	517,000	51,715,510.00	43.24
2	019649	21 国债 01	202,220	20,244,244.20	16.92
3	019654	21 国债 06	12,160	1,216,121.60	1.02

## 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

本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	334,548.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,234,659.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,569,207.89

### 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

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	002532	天山铝业	9,664,116.50	8.08	非公开发行限售
2	688183	生益电子	247,473.00	0.21	科创板打新限售
3	688619	罗普特	155,886.72	0.13	科创板打新限售
4	688656	浩欧博	113,930.10	0.10	科创板打新限售
5	688678	福立旺	89,879.18	0.08	科创板打新限售
6	300919	中伟股份	83,942.10	0.07	创业板打新限售
7	300911	亿田智能	20,057.19	0.02	创业板打新限售
8	300950	德固特	6,563.43	0.01	创业板打新限售

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信鼎诚3个月定开混	创金合信鼎诚3个月定开混
----	--------------	--------------

	合 A	合 C
报告期期初基金份额总额	510,157,358.01	749,341.45
报告期期间基金总申购份额	47,275.02	37,963.47
减：报告期期间基金总赎回份额	400,085,041.49	775,346.13
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	110,119,591.54	11,958.79

## § 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

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	20210401 - 20210418	125,012,125.00	0.00	125,012,125.00	0.00	0.00%
机构	2	20210401 - 20210630	240,024,200.00	0.00	185,024,200.00	55,000,000.00	49.94%
机构	3	20210401 - 20210630	145,014,225.00	0.00	90,014,225.00	55,000,000.00	49.94%

#### 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

本报告期内, 未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信鼎诚 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信鼎诚 3 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信鼎诚 3 个月定期开放混合型证券投资基金 2021 年 2 季度报告原文。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 楼

### 9.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2021 年 7 月 20 日