

创金合信泰盈双季红 6 个月定期开放 债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报 告

2021 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 27 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.....	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.....	7
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.....	8
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.....	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.....	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.....	12
9.1 备查文件目录.....	12
9.2 存放地点.....	12
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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信泰盈双季红定开债券
基金主代码	005836
交易代码	005836
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 16 日
报告期末基金份额总额	521,924,466.39 份
投资目标	在严格控制风险前提下，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。1、封闭期的投资策略（1）资产配置策略：本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定在债券、现金等大类资产之间的配置比例及调整原则。（2）债券投资策略：本基金通过研究主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，预测利率水平变动趋势以及收益率曲线形状变化趋势。在定性分析的基础上，本产品还应用定量分析工具进行辅助分析，以确定组合的久期及期限结构管理策略。本基金投资组合的久期控制在 3 年以内。（3）国债期货投资策略：为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性，本基金将本着谨慎的原则，以套期保值为

	目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。 2、开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的资产，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	中债信用债总财富（1-3 年）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、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	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信泰盈双季红定开债券 A	创金合信泰盈双季红定开债券 C
下属分级基金的交易代码	005836	005837
报告期末下属分级基金的份额总额	488,703,728.89 份	33,220,737.50 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（2021 年 7 月 1 日—2021 年 9 月 30 日）	
	创金合信泰盈双季红定开债券 A	创金合信泰盈双季红定开债券 C
1.本期已实现收益	9,669,378.65	626,853.48
2.本期利润	8,635,615.78	557,139.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0177	0.0168
4.期末基金资产净值	513,074,292.68	34,631,749.02
5.期末基金份额净值	1.0499	1.0425

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

创金合信泰盈双季红定开债券 A

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	1.71%	0.03%	1.17%	0.02%	0.54%	0.01%
过去六个月	2.92%	0.03%	2.45%	0.02%	0.47%	0.01%
过去一年	5.40%	0.03%	4.33%	0.03%	1.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.03%	0.08%	7.85%	0.04%	-0.82%	0.04%

创金合信泰盈双季红定开债券 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	1.64%	0.03%	1.17%	0.02%	0.47%	0.01%
过去六个月	2.78%	0.03%	2.45%	0.02%	0.33%	0.01%
过去一年	5.09%	0.03%	4.33%	0.03%	0.76%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.29%	0.08%	7.85%	0.04%	-1.56%	0.04%

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

创金合信泰盈双季红定开债券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
(2019年10月16日-2021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		
谢创	本基金基金经理	2019年10月16日	-	6	谢创先生，中国国籍，西南财经大学金融工程硕士，2015年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任交易部交易员，固定收益部基金经理助理，现任基金经理。
郑振源	本基金基金经理	2019年10月16日	-	12	郑振源先生，中国国籍，中国人民银行研究生部经济学硕士。2009年7月加入第一创业证券研究所，担任宏观债券研究员。2012年7月加入第一创业证券资产管理部，先后担任宏观债券研究员、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。

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 年三季度债券市场利率水平呈现先下后上的行情。长端方面，10 年国债利率在央行降准操作的带动下，从 7 月初 3.05%附近的平台下行至 9 月末 2.85%附近的平台，短端方面，三季度 7 天回购利率 DR007 平均值为 2.16%，与二季度基本持平，也与央行稳健中性的货币政策的基调相匹配。三季度债券市场行情的主要驱动力在于央行 7 月份意外降准的行为带动了市场宽松预期的提升，从而带来了收益率曲线的整体下行。随后则是市场在逐步修正过度宽松的货币政策预期，市场收益率逐步向上修复到合理水平附近。往后展望，经济仍呈现弱恢复，主要压力仍在于地产领域，消费和工业生产在疫情和能耗双限政策修复下会有所恢复，但工业领域价格上涨压力仍较大；货币政策仍难有大松大紧的基础；四季度债券市场存在一定的分化压力，在理财净值化转型的背景下，利率债表现大概率强于信用债，短债表现大概率强于长债。

报告期内，本基金结合当前及未来宏观政策形势变化的判断，控制信用风险暴露情况，控制组合杠杆总体水平，以稳健的投资风格力争为投资者获取良好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信泰盈双季红定开债券 A 基金份额净值为 1.0499 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.71%，同期业绩比较基准收益率为 1.17%；截至本报告期末创

金合信泰盈双季红定开债券 C 基金份额净值为 1.0425 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 1.17%。

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	738,363,500.00	97.80
	其中：债券	738,363,500.00	97.80
	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	7,076,550.47	0.94
8	其他资产	9,562,957.01	1.27
9	合计	755,003,007.48	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	141,788,000.00	25.89
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	148,938,000.00	27.19
5	企业短期融资券	255,805,500.00	46.70
6	中期票据	182,160,000.00	33.26
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,672,000.00	1.77
9	其他	-	-
10	合计	738,363,500.00	134.81

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	1720059	17 江西银行二级 02	300,000	30,519,000.00	5.57
2	149345	21 长江 01	300,000	30,378,000.00	5.55
3	042100247	21 邯郸建投 CP001	300,000	30,045,000.00	5.49
4	042100394	21 亳州城建 CP002	300,000	30,033,000.00	5.48
5	1920067	19 厦门银行 03	200,000	20,324,000.00	3.71

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

2021 年 5 月 17 日，江西银行股份有限公司（下称“江西银行”）收到中国银保监会江西监管局《行政处罚决定书》，认定江西银行未按规定报送案件信息的行为违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条的规定，并对公司处以罚款 30 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，江西银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，30 万元罚款对公司信用资质影响有限。该公司为地方国企背景城商行，近年发展迅速，各项监管指标满足监管要求，维持原有主体信用评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 17 江西银行二级 02、17 江西银行二级 01 进行了投资。

2021 年 1 月 14 日，衡阳市城市建设投资有限公司（简称：衡阳城投）由于提供不真实统计资料，受到湖南省统计局警告并处罚款。衡阳市经济财政相对较强，在湖南全省排名较为靠前，衡阳城投负责市土地开发、基础设施和保障房受托代建，业务公益属性强，政府支持强，该处罚对发行人信用资质影响较小。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，衡阳城投改正态度积极，并积极整改，上述事件发生后该公司经营状况正常。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 18 衡阳城投 MTN003 进行了投资。

2020 年 12 月 24 日，汉口银行股份有限公司（下称“汉口银行”）收到中国人民银行武汉分行行政处罚（武银罚字[2020]第 17 号），认定汉口银行提供虚假的金融统计报表、未按规定挑剔不宜流通人民币、对外付出不宜流通残损人民币、对商品或者服务作虚假或者引人误解的宣传、侵害消费者个人信息依法得到保护的权利，给予汉口银行警告，并处以 68.5 万元罚款。

2021 年 7 月 28 日，汉口银行收到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局行政处罚（鄂银保监罚决字[2021]17 号），认定汉口银行总行对异地分行管理不到位，对汉口银行处以 35 万元罚款。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，汉口银行改正态度积极，并积极整改，上述事件发生后该公司经营状况正常。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 17 汉口银行二级进行了投资。

2021 年 1 月 11 日，厦门银行股份有限公司（下称“厦门银行”）收到中国银行保险监督管理委员会厦门监管局《行政处罚决定书》，认定厦门银行个人经营性贷款资金被挪用流向房地产领域，处罚款共计 20 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，厦门银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，20 万元罚款对公司信用资质影响有限。该公司各项监管指标满足监管要求，维持原有主体信用评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 19 厦门银行 03 进行了投资。

2020 年 12 月 11 日，厦门银行股份有限公司（下称“厦门银行”）收到国家外汇管理局厦门市分局《行政处罚决定书》，认定厦门银行违规开展外汇交易、违反银行交易记录管理规定的行为违反了《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条第（五）项的规定，责令改正，并处罚款共计 120 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，厦门银行改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，120 万元罚款对公司信用资质影响有限。该公司各项监管指标满足监管要求，维持原有主体信用评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 19 厦门银行 03 进行了投资。

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	59,155.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,503,801.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,562,957.01

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	创金合信泰盈双季红定开债券 A	创金合信泰盈双季红定开债券 C
报告期期初基金份额总额	488,703,728.89	33,220,737.50
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	488,703,728.89	33,220,737.50

§ 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	20210701 - 20210930	488,423,455.03	0.00	0.00	488,423,455.03	93.58%

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。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。截至 2021 年 9 月 30 日,创金合信基金共管理 74 只公募基金,公募管理规模 686 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信泰盈双季红 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信泰盈双季红 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信泰盈双季红 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 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

2021 年 10 月 27 日