

# 创金合信汇悦一年定期开放混合型证 券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 月 29 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

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.....	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.....	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.....	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.....	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.....	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。

基金托管人兴业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	创金合信汇悦一年定开混合	
基金主代码	009768	
交易代码	009768	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日	
报告期末基金份额总额	13,331,014.05 份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	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	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合（全价）指数收益率×40%	
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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信汇悦一年定开混合 A	创金合信汇悦一年定开混合 C
下属分级基金的交易代码	009768	009769
报告期末下属分级基金的份	6,619,560.06 份	6,711,453.99 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 7 月 1 日—2021 年 9 月 29 日）	
	创金合信汇悦一年定开混合 A	创金合信汇悦一年定开混合 C
1.本期已实现收益	18,071,667.31	-14,398.85
2.本期利润	9,642,595.12	-87,183.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.1340	-0.0256
4.期末基金资产净值	7,986,722.42	8,048,911.89
5.期末基金份额净值	1.2065	1.1993

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

创金合信汇悦一年定开混合 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	2.37%	0.69%	-4.13%	0.73%	6.50%	-0.04%
过去六个月	16.39%	0.76%	-1.90%	0.66%	18.29%	0.10%
过去一年	20.99%	1.36%	4.50%	0.73%	16.49%	0.63%
自基金合同生效起至今	20.65%	1.38%	2.33%	0.75%	18.32%	0.63%

创金合信汇悦一年定开混合 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	2.15%	0.69%	-4.13%	0.73%	6.28%	-0.04%
过去六个月	16.02%	0.76%	-1.90%	0.66%	17.92%	0.10%
过去一年	20.38%	1.36%	4.50%	0.73%	15.88%	0.63%
自基金合同生效起至今	19.93%	1.38%	2.33%	0.75%	17.60%	0.63%

### 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：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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何媛	本基金基金经理（已离任）	2020年11月16日	2021年9月29日	6	何媛女士，中国国籍，新加坡国立大学应用经济学硕士研究生，2014年10月加入九泰基金管理有限公司产业投资部任投资经理，2015年11月加入天弘基金管理有限公司资本运作部任总经理助理，2017年8月加入金鹰基金管理有限公司专户投资部任投资总监，2018年9月加入信达澳银基金管理有限公司权益投资总部任副总监，2020年3月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监，现任MOMFOF投资研究部副总监、定增新股策略部副总监、基金经理。
曹春林	本基金基金经理（已离任）	2020年7月16日	2021年8月2日	17	曹春林先生，中国国籍，厦门大学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作。2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作。2010年4月加盟第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，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

2021 年三季度从宏观经济上看，PPI 的持续维持在高位，CPI 则相对平稳，相对的通胀还是体现在生产资料领域。海外疫情的影响叠加碳中和的大背景，经济的逐步恢复对上游的资源需求增加，但收到国内外能耗双控的影响供给始终偏紧，上游资源品和大宗商品维持在紧平衡的状态，从而导致了 PPI 的持续高位。由于上游的价格高位，因此在成本和利润传导的角度看，下游需求强劲和传导较为顺畅的行业和板块会更为受益。从产业链的价值量分配来看，偏重于配置上游的资源品和大宗商品。

从产业链景气度的来看，光伏、新能源车是下游需求的强劲所推动的持续高景气，结合产业链内部利润分配的，侧重于配置在景气行业的上游。同时，受到能耗双控的影响，传统的资源和能源的产量受到限制，但在绿色能源的建设过程中，传统能源依然是主要能源并且需要对绿色能源进行有益的补充，因此传统能源品也会受到拉动。所以三季度在投资策略上围绕了新旧能源和产业链景气进行配置，重点配置在产业链环节内部成本传导较为顺畅，利润分配较多的环节。

进入三季度末，整体景气的产业链板块和传统的资源能源板块涨幅较多，消费和医药和大金融板块具备一定的配置价值，因此有部分增配。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信汇悦一年定开混合 A 基金份额净值为 1.2065 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.37%，同期业绩比较基准收益率为-4.13%；截至本报告期末创金合信汇悦一年定开混合 C 基金份额净值为 1.1993 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.15%，同期业绩比较基准收益率为-4.13%。

#### 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，本基金已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，该情形发生的时间范围为 2021 年 7 月 20 日起并延续至报告期末。

## § 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	8,095,552.92	48.12
	其中：股票	8,095,552.92	48.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	8,300,966.10	49.34
8	其他资产	426,108.70	2.53
9	合计	16,822,627.72	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	728,000.00	4.54
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	-	-
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	7,367,552.92	45.94
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,095,552.92	50.48

### 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	601995	中金公司	15,300	887,400.00	5.53
2	601398	工商银行	187,300	876,564.00	5.47
3	601288	农业银行	293,000	867,280.00	5.41
4	600030	中信证券	33,300	852,813.00	5.32
5	600036	招商银行	15,482	798,251.92	4.98
6	601939	建设银行	130,200	781,200.00	4.87
7	000001	平安银行	42,700	775,005.00	4.83
8	601318	中国平安	15,700	772,283.00	4.82
9	601688	华泰证券	44,100	756,756.00	4.72
10	600519	贵州茅台	400	728,000.00	4.54

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末持有国债期货合约。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

2020 年 11 月 23 日，华泰证券股份有限公司（下称“华泰证券”，股票代码：601688）收到江苏证监局《关于对华泰证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，认定公司 2019 年 8 月存在重大信息安全事件未报告；根据《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》第五十七条的规定，出具警示函的行政监管措施。

本基金投研人员分析认为，在收到警示函后，公司高度重视，强化内控，加强管理，切实做好相关信息安全工作。公司作为券商行业龙头之一，目前估值与可比公司相比低估，维持持有评级。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华泰证券进行了投资。

### 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	425,207.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	901.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	426,108.70

#### 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	创金合信汇悦一年定开混合 A	创金合信汇悦一年定开混合 C
报告期期初基金份额总额	300,272,069.19	5,263.17
报告期期间基金总申购份额	6,604,276.77	6,706,260.82
减：报告期期间基金总赎回份额	300,256,785.90	70.00
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	6,619,560.06	6,711,453.99

## § 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	创金合信汇悦一年定开混合 A	创金合信汇悦一年定开混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	6,604,194.19	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本	6,604,194.19	-

基金份额		
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	99.77	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2021 年 7 月 16 日	6,604,194.19	8,000,000.00	0.00%
合计	-	-	6,604,194.19	8,000,000.00	-

## § 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 - 20210719	150,098,750.00	0.00	150,098,750.00	0.00	0.00%
机构	2	20210701 - 20210719	150,098,750.00	0.00	150,098,750.00	0.00	0.00%
机构	3	20210720 - 20210929	0.00	6,604,194.19	0.00	6,604,194.19	49.54%
机构	4	20210812 - 20210929	0.00	6,623,772.99	0.00	6,623,772.99	49.69%

#### 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、《创金合信汇悦一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信汇悦一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信汇悦一年定期开放混合型证券投资基金 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](http://www.cjxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日