

# 中融创业板两年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30日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人交通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、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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2021年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中融创业板两年定开混合
场内简称	中融创业
基金主代码	168207
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年08月21日
报告期末基金份额总额	362,219,748.84份
投资目标	本基金在控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	1、封闭期投资策略：（1）资产配置策略（2）战略配售股票投资策略（3）股票投资策略（4）港股通投资策略（5）债券投资策略（6）衍生品投资策略（7）资产支持证券投资策略（8）融资交易策略（9）参与转融通证券出借业务策略；2、开放期投资策略。
业绩比较基准	创业板指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

	本基金可投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

### § 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04月01日 - 2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	2,965,953.86
2. 本期利润	60,122,703.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1660
4. 期末基金资产净值	428,738,951.05
5. 期末基金份额净值	1.1836

- 1、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。
- 2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

阶段	净值增长率①	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	16.30%	1.45%	18.02%	1.14%	-1.72%	0.31%
过去六个月	10.00%	1.80%	12.79%	1.39%	-2.79%	0.41%
自基金合同生效起至今	18.36%	1.58%	25.02%	1.30%	-6.66%	0.28%

##### 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

中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年08月21日-2021年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## § 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		
甘传琦	中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期	2020-08-21	-	10	甘传琦先生，中国国籍，毕业于北京大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限10年。2010年7月至2017年3月历任博时基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理助理。2017年4月加入中融基金管理有限公司，现

	混合型证券投资基金的基金经理及权益投资部副总经理。				任权益投资部副总经理。
--	---------------------------	--	--	--	-------------

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

经历1季度先涨后跌的大幅波动之后，在良好流动性预期的支撑下，A股市场在2季度整体表现不错，呈现出以下市场特征：一是有比较鲜明产业趋势的行业涨幅较大，如医药、新能源、白酒、体育用品、芯片等板块；二是市值结构层面更加均衡，一些业绩成长性良好的中盘市值公司股票也表现出超额回报，市场的投资机会更加多元化。

本基金的投资框架未变，根据对社会发展趋势的观察，重点梳理了三个未来有长期持续性的大方向并予以战略聚焦，一是科技制造业，包括新能源、半导体、进口替代空间大的核心材料器件设备等，二是与新一代年轻人消费高度相关的新兴消费品，三是与老龄化相关的医疗健康。我们认为上述每个方向都处在快速发展变化过程中，投资机会

众多，值得重点深入研究。组合的构建将紧密围绕以上社会方向，寻找有竞争力的公司，维持组合的生命力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融创业板两年定开混合基金份额净值为1.1836元，本报告期内，基金份额净值增长率为16.30%，同期业绩比较基准收益率为18.02%。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	380,171,623.50	86.11
	其中：股票	380,171,623.50	86.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,894,887.96	0.66
	其中：债券	2,894,887.96	0.66
	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	56,215,668.29	12.73
8	其他资产	2,196,150.78	0.50
9	合计	441,478,330.53	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	340,022,642.32	79.31
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	18,914,041.58	4.41
J	金融业	8,644,755.60	2.02
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	2,629,464.00	0.61
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	9,960,720.00	2.32
S	综合	-	-
	合计	380,171,623.50	88.67

### 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

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	300122	智飞生物	131,600	24,573,668.00	5.73
2	300034	钢研高纳	690,506	22,241,198.26	5.19
3	300037	新宙邦	217,000	21,721,700.00	5.07
4	300408	三环集团	496,900	21,078,498.00	4.92
5	300415	伊之密	797,600	17,148,400.00	4.00
6	300124	汇川技术	219,622	16,309,129.72	3.80
7	300014	亿纬锂能	154,300	16,036,399.00	3.74
8	300363	博腾股份	171,300	14,409,756.00	3.36
9	300767	震安科技	160,370	13,318,728.50	3.11
10	300627	华测导航	357,750	12,202,852.50	2.85

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	2,179,000.00	0.51
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）	715,887.96	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,894,887.96	0.68

#### 5.5 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债券投资明细

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	21,790	2,179,000.00	0.51
2	123101	拓斯转债	6,572	715,887.96	0.17

#### 5.6 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序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

本基金本报告期末未持有股指期货。



## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	187,312.77
2	应收证券清算款	1,901,099.26
3	应收股利	-
4	应收利息	57,449.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,289.63
8	其他	-
9	合计	2,196,150.78

### 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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	362,219,748.84
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	362,219,748.84

申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无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) 中国证监会准予中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集注册中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

2021年07月21日