

# 创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）2023 年中期报告

2023 年 06 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2023年8月28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2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	4
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
§8 基金份额持有人信息 .....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
§9 开放式基金份额变动 .....	50
§10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
11.1 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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	53
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）	
基金简称	创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）	
基金主代码	012379	
交易代码	012379	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年6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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	669,874,662.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）A	创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C

下属分级基金的交易代码	012379	012380
报告期末下属分级基金的份额总额	490,763,180.68 份	179,111,482.16 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于港股互联网主题相关证券，通过精选个股和严格风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将通过"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略，综合考虑宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，评估股票、债券、货币市场工具及金融衍生品等大类资产的估值水平和投资价值，形成对大类资产预期收益及风险的判断，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	恒生科技指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×30%
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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚胜田
	联系电话	0755-82820166
	电子邮箱	xishengtian@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95559
传真	0755-25832571	021-62701216
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	518052	200336
法定代表人	钱龙海	任德奇

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 香港上海汇丰银行有

			限公司
	英文	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
注册地址		-	香港中环皇后大道中1号香港汇丰银行大厦
办公地址		-	香港中环皇后大道中1号香港汇丰银行大厦
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

##### 1、创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-10,346,712.77
本期利润	-29,863,066.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0597
本期加权平均净值利润率	-9.81%
本期基金份额净值增长率	-9.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-209,588,914.65
期末可供分配基金份额利润	-0.4271
期末基金资产净值	281,174,266.03
期末基金份额净值	0.5729
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-42.71%

##### 2、创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-4,017,309.84
本期利润	-10,741,334.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0587
本期加权平均净值利润率	-9.74%
本期基金份额净值增长率	-9.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-77,510,919.17
期末可供分配基金份额利润	-0.4328
期末基金资产净值	101,600,562.99
期末基金份额净值	0.5672
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-43.28%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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

创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)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
过去一个月	6.82%	1.84%	5.19%	1.38%	1.63%	0.46%
过去三个月	-8.61%	1.53%	-5.71%	1.16%	-2.90%	0.37%
过去六个月	-9.48%	1.74%	-2.41%	1.39%	-7.07%	0.35%
过去一年	-19.64%	2.13%	-11.17%	1.72%	-8.47%	0.41%
自基金合同生效起至今	-42.71%	2.18%	-34.62%	1.89%	-8.09%	0.29%

创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)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
过去一个月	6.78%	1.84%	5.19%	1.38%	1.59%	0.46%
过去三个月	-8.72%	1.53%	-5.71%	1.16%	-3.01%	0.37%
过去六个月	-9.70%	1.74%	-2.41%	1.39%	-7.29%	0.35%
过去一年	-20.05%	2.13%	-11.17%	1.72%	-8.88%	0.41%
自基金合同生效起至今	-43.28%	2.18%	-34.62%	1.89%	-8.66%	0.29%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)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  
(2021年06月30日-2023年06月30日)







## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本26,096万元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.63596%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡尧盛	本基金基金经理	2021年6月30日	-	9	胡尧盛先生，中国国籍，江西财经大学硕士。2013年7月加入国元咨询服务（深圳）有限公司，任研究部研究员，负责港股市场消费品行业研究分析工作。

					2015年6月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究部研究员，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《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；

3、报告截止日至批准送出国日期间，自2023年7月15日起郑剑先生新任本基金的基金经理。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

## 4.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，恒生指数下跌 4.37%，恒生科技下跌 5.27%。在中国经济弱复苏及国际政治环境剧烈变化下，港股市场以震荡为主。

本产品执行自下而上的投资策略，我们主要选择能在长期获取市场份额并有内生长的公司并长期持有，在公司经营与竞争格局等基本面发生变化时进行持仓的调整。本产品于报告期内维持了较高仓位，与上期相比，我们持仓核心标的基本没有变化，主要持仓集中在互联网电商、娱乐、本地生活、短视频等领域的龙头及竞争力较强的标的上。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信港股互联网 3 个月持有期混合（QDII）A 基金份额净值为 0.5729 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.41%；截至本报告期末创金合信港股互联网 3 个月持有期混合（QDII）C 基金份额净值为 0.5672 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.70%，同期业绩比较基准收益率为-2.41%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为市场今年主要关注经济基本面的变化趋势，而在弱复苏的前提下，行业竞争格局的变化成为当前互联网行业投资中市场较为关注的因素。市场当前对于电商行业、本地生活领域内竞争加剧的预期较为充分，而对于行业内公司长期的业务能力与盈利因素则持较为悲观的看法。我们认为互联网行业中龙头公司盈利能力短期会在竞争对手扩大开支的情况下受到限制，而长期来看其市场份额及盈利能力来自于业务模式自身的能力，例如电商行业我们更看重电商公司在营销的过程当中为商户及用户解决了多大的问题产生多大的效益，而在这些效益中能拿到多大的份额，对于本地生活类公司亦是如此。整体来看，我们对于龙头类互联网公司的长期盈利能力保持较为乐观的态度，但份额可能会较大受到对手竞争策略的限制。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.9 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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，创金合信基金管理有限公司在创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由创金合信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,054,882.46	19,021,250.99
结算备付金		-	-
存出保证金		33,595,088.33	33,351,149.80
交易性金融资产	6.4.7.2	336,730,202.40	390,773,032.10
其中：股票投资		336,597,997.54	390,773,032.10
基金投资		-	-
债券投资		132,204.86	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		438,673.03	-
应收申购款		226,605.93	208,887.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		384,045,452.15	443,354,320.37
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		584,498.55	269,217.02
应付管理人报酬		479,042.19	561,330.08
应付托管费		79,840.35	93,555.03
应付销售服务费		42,692.55	50,028.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	84,548.82	175,430.53
负债合计		1,270,623.13	1,149,561.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	669,874,662.84	700,155,026.24
其他综合收益		-	-
未分配利润		-287,099,833.82	-257,950,267.07
净资产合计		382,774,829.02	442,204,759.17
负债和净资产总计		384,045,452.15	443,354,320.37

注：报告截止日2023年6月30日，创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）A份额净值0.5729元，基金份额总额490,763,180.68份；创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C份额净值0.5672元，基金份额总额179,111,482.16份；总份额合计669,874,662.84份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间2022年 1月1日至2022年6月 30日
一、营业总收入		-36,631,055.89	-62,971,702.65
1.利息收入		99,071.64	149,499.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	86,751.09	126,601.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,320.55	22,898.10
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,700,506.36	-94,659,874.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-14,306,291.55	-96,296,261.37
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	82.42	9,935.26
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,605,702.77	1,626,452.09
以摊余成本计量的		-	-

金融资产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-26,240,378.30	29,913,537.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		196,875.40	1,596,480.82
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,881.73	28,653.43
减：二、营业总支出		3,973,345.02	4,586,709.37
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,097,793.50	3,609,292.96
2.托管费	6.4.10.2.2	516,298.88	601,548.82
3.销售服务费	6.4.10.2.3	274,745.66	284,313.33
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		0.28	-
8.其他费用	6.4.7.20	84,506.70	91,554.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40,604,400.91	-67,558,412.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40,604,400.91	-67,558,412.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-40,604,400.91	-67,558,412.02

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	700,155,026.24	-	-257,950,267.07	442,204,759.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产(基金净值)	700,155,026.24	-	-257,950,267.07	442,204,759.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,280,363.40	-	-29,149,566.75	-59,429,930.15
(一)、综合收益总额	-	-	-40,604,400.91	-40,604,400.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-30,280,363.40	-	11,454,834.16	-18,825,529.24
其中:1.基金申购款	28,506,807.09	-	-11,411,243.32	17,095,563.77
2.基金赎回款	-58,787,170.49	-	22,866,077.48	-35,921,093.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	669,874,662.84	-	-287,099,833.82	382,774,829.02
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	730,001,718.08	-	-145,413,273.85	584,588,444.23
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	730,001,718.08	-	-145,413,273.85	584,588,444.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,465,926.84	-	-56,886,484.63	-84,352,411.47
(一)、综合收益总额	-	-	-67,558,412.02	-67,558,412.02
(二)、本期基金	-27,465,926.84	-	10,671,927.39	-16,793,999.45



份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	52,840,426.88	-	-16,803,669.87	36,036,757.01
2.基金赎回款	-80,306,353.72	-	27,475,597.26	-52,830,756.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	702,535,791.24	-	-202,299,758.48	500,236,032.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 苏彦祝 \_\_\_\_\_ 奚胜田 \_\_\_\_\_ 吉祥 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1551 号《关于准予创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 664,027,646.46 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2100104 号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案，《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2021 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 664,149,034.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 121,388.26 份基金份额。本基金的基

基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司（以下简称“汇丰银行”）。

根据《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括境内市场和境外市场依法发行的金融工具，境内市场投资工具包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准及注册上市的股票）、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股投资比例不低于非现金基金资产的 80%），投资于本基金界定的港股互联网主题的证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：恒生科技指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×30%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,054,882.46
等于：本金	13,054,633.65
加：应计利息	248.81
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13,054,882.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	461,759,090.89	-	336,597,997.54	-125,161,093.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	111,100.00	84.74	132,204.86	21,020.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	111,100.00	84.74	132,204.86	21,020.12
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	461,870,190.89	84.74	336,730,202.40	-125,140,073.23	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	246.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	84,548.82

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	512,034,021.48	512,034,021.48
本期申购	10,020,493.89	10,020,493.89
本期赎回（以“-”号填列）	-31,291,334.69	-31,291,334.69
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	490,763,180.68	490,763,180.68

创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	188,121,004.76	188,121,004.76
本期申购	18,486,313.20	18,486,313.20
本期赎回（以“-”号填列）	-27,495,835.80	-27,495,835.80
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	179,111,482.16	179,111,482.16

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

**6.4.7.8 未分配利润——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

单位：人民币元

创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-117,731,634.63	-70,259,816.07	-187,991,450.70
本期利润	-10,346,712.77	-19,516,353.59	-29,863,066.36
本期基金份额交易产生的变动数	4,998,690.94	3,266,911.47	8,265,602.41
其中：基金申购款	-2,377,060.98	-1,522,280.61	-3,899,341.59
基金赎回款	7,375,751.92	4,789,192.08	12,164,944.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-123,079,656.46	-86,509,258.19	-209,588,914.65

创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-44,110,975.76	-25,847,840.61	-69,958,816.37
本期利润	-4,017,309.84	-6,724,024.71	-10,741,334.55
本期基金份额交易产生的变动数	2,158,889.02	1,030,342.73	3,189,231.75
其中：基金申购款	-4,487,383.34	-3,024,518.39	-7,511,901.73
基金赎回款	6,646,272.36	4,054,861.12	10,701,133.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,969,396.58	-31,541,522.59	-77,510,919.17

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,628.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	58,122.29
合计	86,751.09

**6.4.7.10 股票投资收益****6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,306,291.55
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	-14,306,291.55
----	----------------

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	166,560,039.07
减：卖出股票成本总额	180,266,174.21
减：交易费用	600,156.41
买卖股票差价收入	-14,306,291.55

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	82.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	82.42

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。



**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,605,702.77
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,605,702.77

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-26,240,378.30
——股票投资	-26,261,398.42
——债券投资	21,020.12
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-26,240,378.30

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,881.73
合计	13,881.73

**6.4.7.19 信用减值损失**

本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	60.00
其他	144.14
合计	84,506.70

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司	境外资产托管人
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,097,793.50	3,609,292.96
其中：支付销售机构的客户维护费	1,497,742.75	1,745,979.61

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	516,298.88	601,548.82

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信港股互联网 3	创金合信港股互联网 3	合计

	个月持有期混合 (QDII) A	个月持有期混合 (QDII) C	
创金合信直销	-	666.55	666.55
交通银行	-	42.26	42.26
合计	-	708.81	708.81
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信港股互联网 3 个月持有期混合 (QDII) A	创金合信港股互联网 3 个月持有期混合 (QDII) C	合计
创金合信直销	-	228.13	228.13
交通银行	-	7.97	7.97
合计	-	236.10	236.10

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,722,545.47	6,312.44	2,852,726.80	19,484.28
汇丰银行股份有限公司	9,332,336.99	22,316.36	30,209,360.12	124.33

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司及本基金的境外托管行汇丰银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
--------	---------------------	-----------------------

AAA	-	-
AAA 以下	132,204.86	-
未评级	-	-
合计	132,204.86	-

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流

通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银



行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,054,882.46	-	-	-	13,054,882.46
存出保证金	33,595,088.33	-	-	-	33,595,088.33
交易性金融资产	-	-	132,204.86	336,597,997.54	336,730,202.40
应收股利	-	-	-	438,673.03	438,673.03
应收申购款	-	-	-	226,605.93	226,605.93
资产总计	46,649,970.79	-	132,204.86	337,263,276.50	384,045,452.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	584,498.55	584,498.55
应付管理人报酬	-	-	-	479,042.19	479,042.19
应付托管费	-	-	-	79,840.35	79,840.35
应付销售服务费	-	-	-	42,692.55	42,692.55
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	84,548.82	84,548.82
负债总计	-	-	-	1,270,623.13	1,270,623.13
利率敏感度缺口	46,649,970.79	-	132,204.86	335,992,653.37	382,774,829.02
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,021,250.99	-	-	-	19,021,250.99
存出保证金	33,351,149.80	-	-	-	33,351,149.80
交易性金融资产	-	-	-	390,773,032.10	390,773,032.10
应收申购款	-	-	-	208,887.48	208,887.48
资产总计	52,372,400.79	-	-	390,981,919.58	443,354,320.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	269,217.02	269,217.02
应付管理人报酬	-	-	-	561,330.08	561,330.08
应付托管费	-	-	-	93,555.03	93,555.03
应付销售服务费	-	-	-	50,028.54	50,028.54
其他负债	-	-	-	175,430.53	175,430.53
负债总计	-	-	-	1,149,561.20	1,149,561.20
利率敏感度缺口	52,372,400.79	-	-	389,832,358.38	442,204,759.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	0.79	9,332,336.20	-	-	-	9,332,336.99
交易性金融资产	-	303,527,125.10	-	-	-	303,527,125.10
应收股利	-	438,673.03	-	-	-	438,673.03
资产合计	0.79	313,298,134.33	-	-	-	313,298,135.12
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	0.79	313,298,134.33	-	-	-	313,298,135.12

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	-	9,539,432.02	-	-	-	9,539,432.02
交易性金融资产	-	368,086,517.69	-	-	-	368,086,517.69
资产合计	-	377,625,949.71	-	-	-	377,625,949.71
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风	-	377,625,949.71	-	-	-	377,625,949.71

险敞口净额						
-------	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	15,664,906.76	18,881,297.49
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-15,664,906.76	-18,881,297.49	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括境内市场和境外市场依法发行的金融工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	336,597,997.54	87.94	390,773,032.10	88.37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	336,597,997.54	87.94	390,773,032.10	88.37

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	20,611,578.38	23,772,677.41
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,611,578.38	-23,772,677.41

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	336,730,202.40
第二层次	-
第三层次	-
合计	336,730,202.40

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	336,597,997.54	87.65
	其中：普通股	336,597,997.54	87.65
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,204.86	0.03
	其中：债券	132,204.86	0.03
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	13,054,882.46	3.40
8	其他资产	34,260,367.29	8.92
9	合计	384,045,452.15	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为199,090,241.66元，占净值比为52.01%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	303,527,125.10	79.30
中国	33,070,872.44	8.64
合计	336,597,997.54	87.94

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
工业	5,512,508.43	1.44
非必需消费品	151,165,721.36	39.49
必需消费品	10,175,719.23	2.66
医疗保健	3,925,000.39	1.03
金融	18,569,500.02	4.85
信息技术	52,279,513.82	13.66
通讯服务	92,991,981.52	24.29
房地产	1,978,052.77	0.52
合计	336,597,997.54	87.94

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Meituan	美团	3690	香港证券交易所	中国香港	302,500	34,109,341.58	8.91
2	Tencent Holding s Ltd	腾讯控股有限公司	0700	香港证券交易所	中国香港	106,800	32,651,811.06	8.53
3	Kuaisho u Technology	快手科技	1024	香港证券交易所	中国香港	483,800	23,886,187.63	6.24
4	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	9988	香港证券交易所	中国香港	308,200	23,073,323.96	6.03
5	JD.Com , Inc.	京东集团股份有限公司	9618	香港证券交易所	中国香港	169,569	20,699,313.60	5.41
6	Netease, Inc.	网易公司	9999	香港证券交易所	中国香港	132,200	18,599,766.37	4.86
7	Xiaomi Corpora	小米集团	1810	香港证券交易所	中国香港	1,263,200	12,484,995.86	3.26

	tion			所				
8	Baidu, Inc.	百度集团股份有限公司	9888	香港证券交易所	中国香港	83,100	10,174,676.25	2.66
9	Jd Health International Inc.	京东健康股份有限公司	6618	香港证券交易所	中国香港	212,750	9,699,679.07	2.53
10	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018	香港证券交易所	中国香港	566,000	9,622,742.14	2.51
11	Yadea Group Holdings Ltd.	雅迪集团控股有限公司	1585	香港证券交易所	中国香港	546,000	8,970,607.25	2.34
12	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	0388	香港证券交易所	中国香港	31,500	8,573,307.62	2.24
13	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方教育科技(集团)有限公司	9901	香港证券交易所	中国香港	299,000	8,476,914.62	2.21
14	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	金蝶国际软件集团有限公司	0268	香港证券交易所	中国香港	874,000	8,444,894.25	2.21
15	Sunny Optical Technology (Group)	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382	香港证券交易所	中国香港	106,200	7,652,000.67	2.00

	Compan y Limited							
16	H World Group Limited	华住集 团有限 公司	1179	香港证 券交易 所	中国香 港	271,300	7,566,5 28.51	1.98
17	Lakala Paymen t Co., Ltd.	拉卡拉 支付股 份有限 公司	300773	深圳证 券交易 所	中国内 地	395,300	6,894,0 32.00	1.80
18	Shenzho u Internati onal Group Holdings Ltd.	申洲国 际集团 控股有 限公司	2313	香港证 券交易 所	中国香 港	96,200	6,629,9 12.08	1.73
19	ANTA Sports Product s Limited	安踏体 育用品 有限公 司	2020	香港证 券交易 所	中国香 港	81,800	6,037,2 08.02	1.58
20	Xtep Internati onal Holdings Limited	特步国 际控股 有限公 司	1368	香港证 券交易 所	中国香 港	798,500	5,874,8 84.22	1.53
21	Weimob Inc.	微盟集 团	2013	香港证 券交易 所	中国香 港	1,548,0 00	5,423,4 55.15	1.42
22	Bilibili Inc.	哔哩哔哩 股份有 限公司	9626	香港证 券交易 所	中国香 港	44,800	4,820,2 58.96	1.26
23	China Educati on Group Holdings Limited	中国教 育集团 控股有 限公司	0839	香港证 券交易 所	中国香 港	823,000	4,628,6 16.19	1.21
24	Lianchu ang	联创电 子科技	002036	深圳证 券交易	中国内 地	339,200	3,293,6 32.00	0.86



	Electronic Technology Co., Ltd	股份有限公司		所				
25	East Money Information Co., Ltd.	东方财富信息股份有限公司	300059	深圳证券交易所	中国内地	218,462	3,102,160.40	0.81
26	XPeng Inc.	小鹏汽车有限公司	9868	香港证券交易所	中国香港	63,900	2,945,726.10	0.77
27	Fujian Wanchen Biotechnology Co., Ltd	福建万辰生物科技股份有限公司	300972	深圳证券交易所	中国内地	66,100	2,930,874.00	0.77
28	Anhui Ying Jia Distillery Co., Ltd.	安徽迎驾贡酒股份有限公司	603198	上海证券交易所	中国内地	45,300	2,890,140.00	0.76
29	China Literature Limited	阅文集团	0772	香港证券交易所	中国香港	94,000	2,855,648.65	0.75
30	Huakai Yibai Technology Co., Ltd.	华凯易佰科技股份有限公司	300592	深圳证券交易所	中国内地	103,900	2,828,158.00	0.74
31	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特国际集团有限公司	9992	香港证券交易所	中国香港	174,200	2,797,807.32	0.73
32	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331	香港证券交易所	中国香港	66,000	2,564,856.16	0.67
33	Jinxin	锦欣生	1951	香港证	中国香	641,000	2,446,6	0.64

	Fertility Group Limited	殖医疗集团有限公司		券交易所	港		95.21	
34	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	株洲中车时代电气股份有限公司	3898	香港证券交易所	中国香港	74,800	2,013,751.84	0.53
35	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园服务控股有限公司	6098	香港证券交易所	中国香港	212,000	1,978,052.77	0.52
36	China Railway Construction Corporation Limited	中国铁建股份有限公司	601186	上海证券交易所	中国内地	192,000	1,891,200.00	0.49
37	Luzhou Laojiao Co., Ltd	泸州老窖股份有限公司	000568	深圳证券交易所	中国内地	8,500	1,781,345.00	0.47
38	BOE Varitronix Limited	京东方精电有限公司	0710	香港证券交易所	中国香港	150,000	1,559,990.16	0.41
39	Beijing Roborock Technology Co., Ltd.	北京石头世纪科技股份有限公司	688169	上海证券交易所	中国内地	4,328	1,387,903.04	0.36
40	China Railway Signal & Communication Corporation	中国铁路通信信号股份有限公司	688009	上海证券交易所	中国内地	237,779	1,379,118.20	0.36

	tion Limited							
41	Miniso Group Holding Limited	名创优品集团控股有限公司	9896	香港证券交易所	中国香港	39,000	1,188,386.12	0.31
42	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	江苏洋河酒厂股份有限公司	002304	深圳证券交易所	中国内地	9,000	1,182,150.00	0.31
43	Hua Hong Semiconductor Limited	华虹半导体有限公司	1347	香港证券交易所	中国香港	46,000	1,085,723.65	0.28
44	Sisram Medical Ltd	复锐医疗科技有限公司	1696	香港证券交易所	中国香港	120,000	1,033,355.18	0.27
45	China Railway Construction Corporation Limited	中国铁建股份有限公司	1186	香港证券交易所	中国香港	184,500	979,806.59	0.26
46	BYD Electronic (International) Company Limited	比亚迪电子(国际)有限公司	0285	香港证券交易所	中国香港	44,000	961,440.74	0.25
47	Ligao Foods Co.,Ltd.	立高食品股份有限公司	300973	深圳证券交易所	中国内地	9,900	677,358.00	0.18
48	Arrow Home Group Co.,	箭牌家居集团股份有限公司	001322	深圳证券交易所	中国内地	37,500	627,750.00	0.16

	Ltd.							
49	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	海信家电集团股份有限公司	000921	深圳证券交易所	中国内地	23,300	627,935.00	0.16
50	Zhejiang Entive Smart Kitchen Appliance Co., Ltd.	浙江亿田智能厨电股份有限公司	300911	深圳证券交易所	中国内地	14,600	554,362.00	0.14
51	Li Auto Inc.	理想汽车	2015	香港证券交易所	中国香港	4,000	499,713.16	0.13
52	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	周黑鸭国际控股有限公司	1458	香港证券交易所	中国香港	176,000	498,164.23	0.13
53	Imeik Technology Development Co., Ltd.	爱美客技术发展股份有限公司	300896	深圳证券交易所	中国内地	1,000	444,950.00	0.12
54	Wus Printed Circuit (Kunshan) Co., Ltd.	沪士电子股份有限公司	002463	深圳证券交易所	中国内地	16,800	351,792.00	0.09
55	Hebei Hengshui Laobaigan	河北衡水老白干酒业股份有限公司	600559	上海证券交易所	中国内地	8,800	215,688.00	0.06

	Liquor Co.,Ltd.							
56	Focuslight Technologies Inc.	西安炬光科技股份有限公司	688167	上海证券交易所	中国内地	96	10,324.80	0.00
57	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际集成电路制造有限公司	0981	香港证券交易所	中国香港	500	9,404.20	0.00
58	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家股份有限公司	6690	香港证券交易所	中国香港	200	4,545.36	0.00
59	Xd Inc.	心动有限公司	2400	香港证券交易所	中国香港	200	3,632.60	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Lakala Payment Co., Ltd.	300773	9,992,673.80	2.26
2	Yadea Group Holdings Ltd.	1585	8,732,924.62	1.97
3	Bilibili Inc.	9626	8,636,941.99	1.95
4	Weimob Inc.	2013	7,039,611.17	1.59
5	Meituan	3690	109,350.91	0.02
6	China Education Group Holdings Limited	0839	5,949,729.74	1.35
7	China Literature Limited	0772	4,379,412.09	0.99
8	Kuaishou Technology	1024	4,354,429.32	0.98
9	Alibaba Health	0241	4,347,730.76	0.98

	Information Technology Limited			
10	Jinxin Fertility Group Limited	1951	4,287,352.09	0.97
11	Huakai Yibai Technology Co.,Ltd.	300592	4,174,373.00	0.94
12	Alibaba Group Holding Limited	9988	3,753,383.46	0.85
13	Beijing Roborock Technology Co., Ltd.	688169	3,688,750.29	0.83
14	ANTA Sports Products Limited	2020	3,503,759.99	0.79
15	Yeahka Limited	9923	3,439,316.00	0.78
16	Sisram Medical Ltd	1696	3,371,998.94	0.76
17	China Railway Construction Corporation Limited	1186	1,152,271.28	0.26
18	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901	3,230,904.56	0.73
19	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	000921	2,792,390.00	0.63
20	Zhejiang Entive Smart Kitchen Appliance Co., Ltd.	300911	2,781,112.00	0.63

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Semiconductor Manufacturing International Corporation	0981	11,010,404.52	2.49

2	Yadea Group Holdings Ltd.	1585	10,167,657.13	2.30
3	Kingsoft Corporation Limited	3888	6,882,504.04	1.56
4	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382	6,514,631.48	1.47
5	Li Auto Inc.	2015	6,273,896.44	1.42
6	KE Holdings Inc.	2423	5,674,618.34	1.28
7	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	0268	5,189,243.18	1.17
8	Netease, Inc.	9999	5,071,773.95	1.15
9	China Literature Limited	0772	5,044,359.81	1.14
10	Hua Hong Semiconductor Limited	1347	4,829,034.38	1.09
11	Bilibili Inc.	9626	4,562,121.16	1.03
12	Tencent Holdings Ltd.	0700	4,493,333.85	1.02
13	ANTA Sports Products Limited	2020	4,066,257.66	0.92
14	East Money Information Co., Ltd.	300059	4,008,478.00	0.91
15	Li Ning Co. Ltd.	2331	3,950,824.98	0.89
16	Alibaba Health Information Technology Limited	0241	3,593,138.73	0.81
17	Yeahka Limited	9923	3,398,561.90	0.77
18	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	0921	2,804,011.00	0.63
19	Guangzhou Holike Creative Home Co.,Ltd.	3898	2,699,278.92	0.61
20	Zhejiang Entive Smart Kitchen	300911	2,474,177.00	0.56

	Appliance Co., Ltd.			
--	------------------------	--	--	--

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本（成交）总额	152,268,459.36
卖出收入（成交）总额	166,560,039.07

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
未评级	132,204.86	0.03

### 7.7 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	123179	立高转债	1,111	132,204.86	0.03

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。



## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,595,088.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	438,673.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	226,605.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,260,367.29

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)	7,021	69,899.33	20,544,640.11	4.19%	470,218,540.57	95.81%

A						
创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)C	3,564	50,255.75	1,020,106.20	0.57%	178,091,375.96	99.43%
合计	10,266	65,251.77	21,564,746.31	3.22%	648,309,916.53	96.78%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)A	683,033.66	0.14%
	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)C	128,887.22	0.07%
	合计	811,920.88	0.12%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)A	0
	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)A	50~100
	创金合信港股互联网3个月持有期混合(QDII)C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）A	创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C
基金合同生效日(2021年6月30日)基金份额总额	515,880,187.12	148,268,847.60
本报告期期初基金份额总额	512,034,021.48	188,121,004.76
本报告期基金总申购份额	10,020,493.89	18,486,313.20
减：报告期基金总赎回份额	31,291,334.69	27,495,835.80
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	490,763,180.68	179,111,482.16

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	2,026,137.27	0.70%	1,013.07	0.47%	-
中金香港	1	17,457,385.87	6.06%	8,728.69	4.01%	-
恒泰证券	2	268,389,363.04	93.23%	207,983.30	95.53%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能为基金提供全面的信息服。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内新增长江证券2个交易单元、华福证券2个交易单元、华西证券2个交易单元、太平洋证券2个交易单元、德邦证券2个交易单元、国泰君安证券2个交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

中金香港	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）2022年第4季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
3	创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购（含定期定额投资）及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-09
4	创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）2022年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分基金2023年非港股通交易日申购赎回等业务安排的公告	公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	创金合信港股互联网3个月持有期混合型证券投资基金（QDII）2023年第1季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本基金本报告期末未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 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。2022年7月，创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。截至2023年6月30日，创金合信基金共管理95只公募基金，公募管理规模1161.93亿元。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 2、《创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 3、创金合信港股互联网 3 个月持有期混合型证券投资基金（QDII）2023 年中期报告原文。

### 12.2 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

### 12.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日