

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 3 季度报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 24 日

目录

| | |
|--|----|
| §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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介..... | 5 |
| 4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 5 |
| 4.4 公平交易专项说明..... | 5 |
| 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明..... | 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 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布..... | 7 |
| 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合..... | 7 |
| 5.4 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及存托凭证投资 明细..... | 8 |
| 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 9 |
| 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五名债券投资明细..... | 9 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 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金融衍生品投资 明细..... | 9 |
| 5.9 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基金投资 明细..... | 9 |
| 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 10 |
| 5.12 投资组合报告附注..... | 10 |
| §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..... | 11 |
| §9 备查文件目录..... | 11 |
| 9.1 备查文件目录..... | 11 |
| 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2023年10月20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2023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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 662,254,566.67份 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 483,014,462.04 份 | 179,240,104.63 份 |
| 境外资产托管人 | 英文名称: The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | |
| | 中文名称: 香港上海汇丰银行有限公司 | |

§ 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 (2023年7月1日—2023年9月30日) | |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| | 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 |
| 1. 本期已实现收益 | -8,189,565.25 | -3,131,090.23 |
| 2. 本期利润 | -7,995,240.97 | -3,074,206.46 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0164 | -0.0172 |
| 4. 期末基金资产净值 | 268,452,948.98 | 98,506,679.03 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.5558 | 0.5496 |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -2.98% | 1.58% | -2.34% | 1.32% | -0.64% | 0.26% |
| 过去六个月 | -11.34% | 1.55% | -7.92% | 1.24% | -3.42% | 0.31% |
| 过去一年 | 0.87% | 2.10% | 8.69% | 1.72% | -7.82% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | -44.42% | 2.12% | -36.15% | 1.83% | -8.27% | 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | ② | | 准差④ | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -3.10% | 1.58% | -2.34% | 1.32% | -0.76% | 0.26% |
| 过去六个月 | -11.55% | 1.55% | -7.92% | 1.24% | -3.63% | 0.31% |
| 过去一年 | 0.37% | 2.10% | 8.69% | 1.72% | -8.32% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | -45.04% | 2.12% | -36.15% | 1.83% | -8.89% | 0.29% |

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09月30日)



创金合信港股互联网3个月持有期混合（QDII）C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 | | |
| 郑剑 | 本基金基金经理 | 2023年7月15日 | - | 9 | 郑剑先生，中国国籍，西安交通大学硕士。2012年6月加入淘宝（中国）软件有限公司，任用户研究员，2014年3月加入国信证券股份有限公司，任经济研究所行业研究员，2015年6月加入蓝海资产管理有限公司，任投资研究部投资经理，2021年4月加入浦银安盛基金管理有限公司，任价值投资部基金经理助理、研究员，2021年12月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部基金经理助理，现任基金经理。 |
| 胡尧盛 | 本基金基金经理 | 2021年6月30日 | - | 10 | 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。

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 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。

4.4 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们重点投资在全球范围内都具有经营与估值优势的中国互联网公司，主要关注企业自身业务在经济下行期的韧性与估值是否有全球范围内的低估优势。我们主要选择：1、能够长期获取市场份额，并不断提升自身利润率的具有竞争优势的龙头公司。这些公司主要是来自于本地生活与外卖、短视频、行业垂直类方向等行业依然有成长性的公司。2、极度低估、业务已经触底且竞争格局稳定的反转类公司，主要是电商零售类公司，在线教育类公司居多。互联网行业在未来经济下行期具有较强的拉动消费、提供就业岗位的能力，行业增速已经在回归正常水平的道路上。在当前市值低估的前提下，互联网行业基本面下行空间小。国内反垄断、国际政治等因素导致外资流出的状况也接近尾声，互联网行业具有较强的安全边际。

本季度，我们适度降低了广告与短视频相关公司的持仓，增加了电商、教育等领域的持仓，整体持仓水平较为稳定。

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 0.5558 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.98%，同期业绩比较基准收益率为-2.34%；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 0.5496 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.10%，同期业绩比较基准收益率为-2.34%。

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

| 序号 | 项目 | 金额（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-----------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 315,405,300.31 | 85.71 |
| | 其中：普通股 | 309,658,765.30 | 84.15 |
| | 存托凭证 | 5,746,535.01 | 1.56 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 18,604,536.42 | 5.06 |
| 8 | 其他资产 | 33,979,278.12 | 9.23 |
| 9 | 合计 | 367,989,114.85 | 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 186,561,858.07 元，占净值比为 50.84%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 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 | 285,105,850.14 | 77.69 |
| 中国 | 24,552,915.16 | 6.69 |
| 美国 | 5,746,535.01 | 1.57 |
| 合计 | 315,405,300.31 | 85.95 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|--------------|--------------|
| 能源 | 399,360.00 | 0.11 |
| 工业 | 2,885,045.00 | 0.79 |

| | | |
|--------|----------------|-------|
| 非必需消费品 | 139,022,003.87 | 37.88 |
| 必需消费品 | 15,599,726.49 | 4.25 |
| 医疗保健 | 356,396.00 | 0.10 |
| 金融 | 14,642,267.71 | 3.99 |
| 信息技术 | 51,917,284.38 | 14.15 |
| 通讯服务 | 84,085,515.54 | 22.91 |
| 房地产 | 6,497,701.32 | 1.77 |
| 合计 | 315,405,300.31 | 85.95 |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.4 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及存托凭证投资明细

| 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 | 30,758,471.26 | 8.38 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | 0700 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 106,800 | 29,198,546.14 | 7.96 |
| 3 | 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 | 266,700 | 20,949,052.44 | 5.71 |
| 4 | Kuaishou Technology | 快手科技 | 1024 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 340,100 | 19,364,934.00 | 5.28 |
| 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 | 17,888,018.52 | 4.87 |
| 6 | Netease, Inc. | 网易公司 | 9999 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 112,000 | 16,392,542.32 | 4.47 |
| 7 | Xiaomi Corporation | 小米集团 | 1810 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,336,000 | 14,368,177.13 | 3.92 |
| 8 | Hong Kong | 香港交易及结算 | 0388 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 45,100 | 11,736,818.04 | 3.20 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------------|------|---------|------|---------|---------------|------|
| | Exchanges and Clearing Ltd. | 算所有有限公司 | | 所 | | | | |
| 9 | Baidu, Inc. | 百度集团股份有限公司 | 9888 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 93,150 | 11,402,663.08 | 3.11 |
| 10 | H World Group Limited | 华住集团有限公司 | 1179 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 393,300 | 11,133,884.67 | 3.03 |

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

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。

5.12.3 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 | 33,165,128.59 |
| 2 | 应收清算款 | 274,642.37 |
| 3 | 应收股利 | 147,433.78 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 392,073.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 33,979,278.12 |

5.12.4 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。

5.12.5 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 |
|---------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 490,763,180.68 | 179,111,482.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,609,426.66 | 6,691,956.67 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 12,358,145.30 | 6,563,334.20 |
| 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 | 483,014,462.04 | 179,240,104.63 |

§ 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

本基金本报告期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。

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。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 9 月 30 日，创金合信基金共管理 97 只公募基金，公募管理规模 1124.96 亿元。

§ 9 备查文件目录

9.1 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 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.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日