

创金合信全球芯片产业股票型发起式 证券投资基金（QDII）2023 年第 4 季度 报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 1 月 19 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.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	6
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.....	6
4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	6
4.4 公平交易专项说明.....	6
4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	7
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 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布.....	8
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合.....	8
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.....	10
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.....	10
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
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.....	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.....	12
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	12
8.1 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	12
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
9.1 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
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§10 备查文件目录.....	13
10.1 备查文件目录.....	13
10.2 存放地点.....	13
10.3 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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年1月17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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）
基金主代码	017653
交易代码	017653
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年3月24日
报告期末基金份额总额	23,212,396.12份
投资目标	本基金主要精选全球芯片产业相关证券，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。
投资策略	1、资产配置策略：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。2、国别/地区配置策略：在进行国别/地区配置时，本基金可参考以下因素：（1）基金管理人对相关国家或地区芯片行业投资价值的判断；（2）相关国家或地区政治经济因素，包括政治局势、经济状况、货币政策、财政政策、贸易差额、贸易结构、产业结构、利率走势、汇率走势、金融市场风险预期及大宗商品价格趋势和国际经济周期对经济的影响等；（3）基金管理人对相关国家或地区的相对估值水平的判断。3、全球芯片产业主题的界定：本基金将在全球范围内精选芯片相关产业链中的具备商业竞争力、可持续发展且能够创造更高社会价值、掌握核心技术

	<p>并积极寻求突破的优质企业；掌握前沿技术的创新企业；以及承载产业转移的新兴市场优秀企业，为投资者带来更长期的回报。本基金所定义的全球芯片产业主题相关行业和公司包括如下两类：（1）芯片的基础研发及制造的相关产业。主要包括芯片的基础研发软件、设计、制造、封测、设备以及材料等相关产业链环节。行业主要涵盖半导体、电子、计算机、通信、电气设备、机械设备、以及化工中的半导体材料等；（2）芯片的拓展应用相关产业。芯片作为高端工业的核心产品，并非直接投向消费市场，而需持续寻找、开发新的应用领域，不断拓展新的发展空间。此类拓展应用相关产业代表着技术应用升级的主要方向。涉及领域主要包括互联网、家用电器中与半导体相关产品或投资半导体相关产业的企业、以及汽车中与自研、生产汽车半导体相关产品或投资半导体相关产业的企业等。同时，本基金将对有关公司的发展进行密切跟踪，随着公司的不断发展，相关上市公司的范围也会相应改变，本基金在履行适当程序后可调整上述界定标准。本基金由于上述原因调整界定范围应及时告知基金托管人，经履行适当程序后，在更新的招募说明书中进行公告。</p> <p>4、权益类品种投资策略：（1）行业配置策略。（2）公司选择策略。（3）组合构建与调整。（4）港股通标的股票投资策略。（5）境内发行的存托凭证投资策略。</p> <p>5、固定收益品种投资策略：（1）债券投资策略。（2）信用债投资策略。（3）可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>6、基金投资策略。本基金也通过翔实的案头研究和深入的实地调研，结合定量和定性分析，精选出优秀的芯片领域偏股型基金进入组合。</p> <p>7、金融衍生品投资策略。（1）股指期货、股票期权投资策略。（2）国债期货投资策略。紧密跟踪汇率动向，通过对各国/地区的宏观经济形势、货币政策、市场环境以及其他可能影响汇率走势的因素进行深入分析，并结合相关外汇研究机构的成果，研判主要汇率走势，并适度投资外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具，以降低外汇风险。</p> <p>8、其他。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>MSCI 全球半导体与设备指数收益率（经估值汇率调整）*60%+中证芯片产业指数收益率*30%+中债总指数收益率*10%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）A	创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码	017653	017654
报告期末下属分级基金的份额总额	7,818,945.98 份	15,393,450.14 份
境外资产托管人	英文名称：JPMorgan Chase Bank,N.A.	
	中文名称：摩根大通银行	

§ 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10月1日—2023年12月31日）	
	创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）A	创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）C
1.本期已实现收益	-170,214.76	-283,643.66
2.本期利润	723,669.87	1,706,960.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0929	0.1088
4.期末基金资产净值	8,449,513.94	16,571,270.98
5.期末基金份额净值	1.0806	1.0765

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

创金合信全球芯片产业股票发起（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	9.49%	1.05%	11.74%	0.94%	-2.25%	0.11%
过去六个月	-1.85%	1.12%	3.87%	0.99%	-5.72%	0.13%
自基金合同生效起至今	8.06%	1.11%	16.99%	1.12%	-8.93%	-0.01%

创金合信全球芯片产业股票发起（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
过去三个月	9.36%	1.05%	11.74%	0.94%	-2.38%	0.11%
过去六个月	-2.10%	1.12%	3.87%	0.99%	-5.97%	0.13%
自基金合同生效起至今	7.65%	1.11%	16.99%	1.12%	-9.34%	-0.01%

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：1、本基金合同于2023年3月24日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、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		
刘扬	本基金基金经理	2023年3月24日	-	9	刘扬先生，中国国籍，中国科学院遥感应用研究所硕士。2014年3月加入长城证券有限责任公司，任金融研究所高级研究员，2015年3月加入前海人寿保险股份有限公司，历任资产管理中心研究发展部行业研究员、权益投资部投资经理、境外投资部权益投资经理，2021年7月加入创金合信基金管理有限公司，曾任行业投资研究部研究员，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 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

全球半导体产业链整体Q3触底，AI创新聚焦在海外科技龙头。四季度海外硬科技涨幅较大，AI龙头盈利创新高。我们抓紧核心AI科技龙头，同时，布局新一轮科技创新大潮和新一轮半导体上行周期中的新兴市场投资机会，在四季度，基金管理人付出大量努力，新开中国台湾、日本、新加坡等市场的投资席位，完成了我们构建产品投资目标市场的第二阶段工作。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）A基金份额净值为1.0806元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.49%，同期业绩比较基准收益率为11.74%；截至本报告期末创金合信全球芯片产业股票发起（QDII）C基金份额净值为1.0765元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.36%，同期业绩比较基准收益率为11.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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	23,477,282.18	91.97
	其中：普通股	22,151,400.74	86.78
	存托凭证	1,325,881.44	5.19
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	1,381,817.91	5.41
8	其他资产	666,693.76	2.61
9	合计	25,525,793.85	100.00

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（%）
美国	15,007,885.76	59.98
中国	5,272,397.43	21.07
台湾	3,196,998.99	12.78
合计	23,477,282.18	93.83

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（%）
非必需消费品	1,724,711.11	6.89
信息技术	20,503,970.53	81.95
通讯服务	1,248,600.54	4.99
合计	23,477,282.18	93.83

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	AMD	美国超威半导体公司	AMD	纳斯达克证券交易所	美国	2,200	2,296,933.78	9.18
2	BROA	博通股	AVGO	纳斯达克	美国	260	2,055,5	8.22

	DCOM	份有限公司		克证券 交易所			76.61	
3	MICRO SOFT	微软公 司	MSFT	纳斯达 克证券 交易所	美国	680	1,811,09 7.39	7.24
4	TESLA	特斯拉 公司	TSLA	纳斯达 克证券 交易所	美国	980	1,724,71 1.11	6.89
5	TAIWA N SEMIC ONDU CTOR	台湾积 体电路 制造股 份有限 公司	TSM	纽约证 券交易 所	美国	1,800	1,325,8 81.44	5.30
6	Alphabe t	谷歌	GOOG L	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,262	1,248,6 00.54	4.99
7	APPLE	苹果公 司	AAPL	纳斯达 克证券 交易所	美国	900	1,227,2 69.01	4.90
8	NVIDI A	英伟达	NVDA	纳斯达 克证券 交易所	美国	300	1,052,2 48.41	4.21
9	TEXAS INSTR UMEN TS	德州仪 器	TXN	纳斯达 克证券 交易所	美国	827	998,451 .19	3.99
10	INTEL	英特尔	INTC	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,000	711,811. 35	2.84

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	2,021.80

2	应收清算款	586,609.01
3	应收股利	4,820.91
4	应收利息	-
5	应收申购款	73,242.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	666,693.76

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	创金合信全球芯片产业股票 发起（QDII）A	创金合信全球芯片产业股票 发起（QDII）C
报告期期初基金份额总额	7,808,051.65	12,055,253.04
报告期期间基金总申购份额	655,763.97	8,783,109.41
减：报告期期间基金总赎回 份额	644,869.64	5,444,912.31
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	7,818,945.98	15,393,450.14

§ 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	创金合信全球芯片产业股票 发起（QDII）A	创金合信全球芯片产业股票 发起（QDII）C
报告期期初管理人持有的本 基金份额	5,000,450.09	5,000,450.00
报告期期间买入/申购总份额	-	6,192,367.53
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本 基金份额	5,000,450.09	11,192,817.53
报告期期末持有的本基金份	63.95	72.71

额占基金总份额比例（%）		
--------------	--	--

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	2023 年 10 月 19 日	3,024,803.39	3,000,000.00	0.00%
2	申购	2023 年 10 月 30 日	3,167,564.14	3,000,000.00	0.00%
合计	-	-	6,192,367.53	6,000,000.00	-

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人 固有资金	16,193,267.62	69.76	10,000,900.09	43.08	36 个月
基金管理人 高级管理人员	58,286.49	0.25	20,006.30	0.09	36 个月
基金经理等 人员	75,992.55	0.33	4,997.16	0.02	36 个月
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	16,327,546.66	70.34	10,025,903.55	43.19	36 个月

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20231001 - 20231231	10,000,900.09	6,192,367.53	0.00	16,193,267.62	69.76%
----	---	------------------------	---------------	--------------	------	---------------	--------

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。

9.2 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 12 月 31 日,创金合信基金共管理 100 只公募基金,公募管理规模 1188.70 亿元。

§ 10 备查文件目录**10.1 备查文件目录**

- 1、《创金合信全球芯片产业股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 2、《创金合信全球芯片产业股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 3、创金合信全球芯片产业股票型发起式证券投资基金(QDII)2023 年 4 季度报告原文。

10.2 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

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日