

创金合信软件产业股票型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：华福证券有限责任公司

送出日期：2024 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.....	4
§4 管理人报告.....	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	6
4.3 公平交易专项说明.....	6
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.....	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 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	8
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.....	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	9
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.....	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十名资产支持证券投资明 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序的前五名贵金属投资明细.....	10
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.....	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	10
5.11 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
§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.....	12
§10 备查文件目录.....	12
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。

基金托管人华福证券有限责任公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信软件产业股票发起
基金主代码	016073
交易代码	016073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	133,802,682.48 份
投资目标	本基金主要投资于软件产业相关股票，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、股票投资策略：（1）软件产业主题的界定。根据《"十四五"软件和信息技术服务业发展规划》（工业和信息化部），本基金所界定的软件产业主题是指在我国数字化进程、新一轮科技革命以及产业变革阶段，提供不同场景下的软件产品和 IT 服务解决方案，促使生产方式升级和生产关系变革，创新驱动新一代信息技术和数字经济发展的公司。主要集中在计算机、通信、传媒、互联网行业，以及部分推进网络化和数字化的传统行业。具体包括以下类别的企业：1）基础软件、工业软件生产企业中具备核心技术竞争优势和强劲创新潜力，未

	来可能持续增长的企业。2) 新兴平台软件、行业应用软件和嵌入式软件生产企业中, 依靠自身软件产品核心优势竞争力及创新能力, 促进行业数字化和企业软件化等领域中的企业。3) 软件赋能和新一代信息服务技术领域, 以加快产业数字化进程, 支撑制造业数字化转型, 促进服务信息消费扩大升级, 推进重点领域数字化发展等领域, 进行开发、拓展和应用的企业。(2) 个股投资策略。(3) 港股通标的股票投资策略。(4) 存托凭证的投资策略。3、固定收益品种投资策略:(1) 债券投资策略。(2) 资产支持证券投资策略。(3) 可转换债券及可交换债券投资策略。4、金融衍生品投资策略:(1) 股指期货、股票期权合约投资策略。(2) 国债期货投资策略。5、融资投资策略。6、其他。	
业绩比较基准	中证全指软件指数收益率*80%+中证港股通综合指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%	
风险收益特征	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。本基金除可投资 A 股外, 还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。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、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	华福证券有限责任公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信软件产业股票发起 A	创金合信软件产业股票发起 C
下属分级基金的交易代码	016073	016074
报告期末下属分级基金的份额总额	40,060,697.00 份	93,741,985.48 份

§ 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 (2024 年 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日)	
	创金合信软件产业股票发起 A	创金合信软件产业股票发起 C
1. 本期已实现收益	-5,909,477.08	-10,725,494.65
2. 本期利润	6,544,017.26	15,387,758.24
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1372	0.1836
4. 期末基金资产净值	42,623,435.99	98,739,814.46
5. 期末基金份额净值	1.0640	1.0533

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

创金合信软件产业股票发起 A

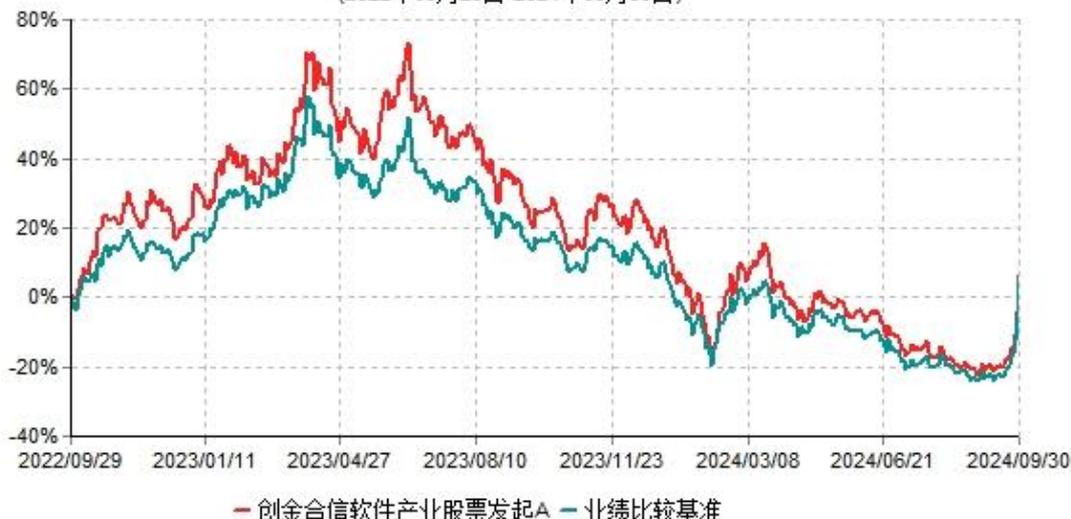
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.34%	2.28%	23.44%	2.30%	-4.10%	-0.02%
过去六个月	3.29%	1.98%	8.20%	1.99%	-4.91%	-0.01%
过去一年	-14.84%	2.20%	-9.72%	1.96%	-5.12%	0.24%
自基金合同生效起至今	6.40%	2.17%	4.95%	1.85%	1.45%	0.32%

创金合信软件产业股票发起 C

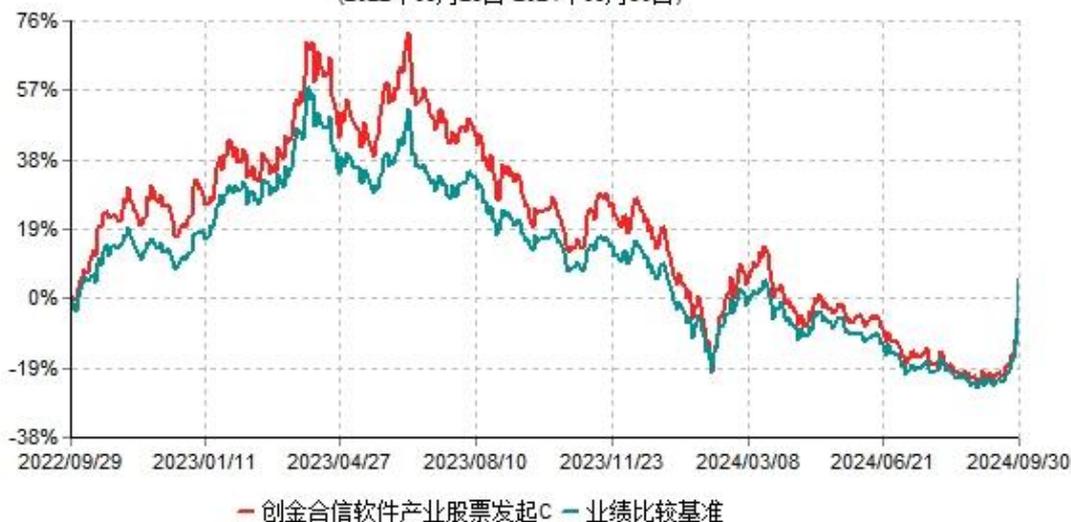
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.19%	2.28%	23.44%	2.30%	-4.25%	-0.02%
过去六个月	3.02%	1.98%	8.20%	1.99%	-5.18%	-0.01%
过去一年	-15.27%	2.21%	-9.72%	1.96%	-5.55%	0.25%
自基金合同生效起至今	5.33%	2.17%	4.95%	1.85%	0.38%	0.32%

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

创金合信软件产业股票发起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
(2022年09月29日-2024年09月30日)



创金合信软件产业股票发起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
(2022年09月29日-2024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		
刘扬	本基金基金经理	2022年9月29日	-	10	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 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。

4.3 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

三季度我们分析认为：软科技的基本面较弱并没有复苏，但股价下行已经得到充分反应，预计后续分化较大；而港股互联网基本面已经开始复苏，市场波动更多来自于国际资金配置需求。我们认为：软件产业投资方向非常具有弹性。如果第三季度科技板块行情修

复向上，则软科技行情大概率也会跟随，且爆发性更强。所以，三季度重点关注信创、AI 应用落地进展和港股互联网的弹性机会。

经过事实上的内外部宏观因素变好，A 股在 9 月中下开始有了较大幅度的反弹，软科技特别是计算机和港股互联网，是反弹弹性较大的板块之一。我们在反弹中，进一步优化持仓，更加聚焦未来业绩复苏的确定性和技术创新的突破性方面。同时，我们认为中国财政状况的修复，特别有利于 2G 类业务的公司的业绩修复，而技术创新和产业升级突围的需求，或将是四季度软科技行情的领头羊，比如华为鸿蒙产业链和 AI 智能算法应用等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信软件产业股票发起 A 基金份额净值为 1.0640 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.34%，同期业绩比较基准收益率为 23.44%；截至本报告期末创金合信软件产业股票发起 C 基金份额净值为 1.0533 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.19%，同期业绩比较基准收益率为 23.44%。

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

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	128,271,911.49	85.35
	其中：股票	128,271,911.49	85.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,902,482.52	4.59
	其中：债券	6,902,482.52	4.59
	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	8,110,326.37	5.40
8	其他资产	7,000,688.73	4.66

9	合计	150,285,409.11	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 35,668,229.33 元，占净值比为 25.23%。

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	2,340,000.00	1.66
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	84,464,382.16	59.75
J	金融业	5,799,300.00	4.10
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	92,603,682.16	65.51

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	775,539.40	0.55
日常消费品	2,894,745.90	2.05
金融	2,353,311.18	1.66
信息技术	10,585,211.02	7.49
通讯业务	19,059,421.83	13.48
合计	35,668,229.33	25.23

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600536	中国软件	237,346	9,947,170.86	7.04
2	688692	达梦数据	30,787	9,651,724.50	6.83
3	688111	金山办公	34,737	9,253,936.80	6.55
4	300188	国投智能	600,000	8,958,000.00	6.34
5	002230	科大讯飞	200,000	8,888,000.00	6.29
6	H00772	阅文集团	300,000	8,765,398.80	6.20
7	H00700	腾讯控股	20,000	8,018,716.68	5.67
8	300496	中科创达	150,000	7,882,500.00	5.58
9	603383	顶点软件	170,000	6,409,000.00	4.53
10	300033	同花顺	30,000	5,799,300.00	4.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	6,902,482.52	4.88
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,902,482.52	4.88

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

金额单位：人民币元

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	019733	24 国债 02	68,000	6,902,482.52	4.88

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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	992,981.97

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,007,706.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,000,688.73

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	创金合信软件产业股票发起 A	创金合信软件产业股票发起 C
报告期期初基金份额总额	48,935,637.92	84,720,988.48
报告期期间基金总申购份额	5,102,024.52	50,046,439.74
减：报告期期间基金总赎回份额	13,976,965.44	41,025,442.74
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	40,060,697.00	93,741,985.48

§ 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	创金合信软件产业股票发起 A	创金合信软件产业股票发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,222.26	5,000,222.22
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	5,000,222.26	5,000,222.22
报告期期末持有的本基金份	12.48	5.33

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

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 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	10,000,444.48	7.47	10,000,444.48	7.47	36 个月
基金管理人高级管理人员	28,994.85	0.02	-	-	-
基金经理等人员	77,777.67	0.06	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,107,217.00	7.55	10,000,444.48	7.47	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

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。

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，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 家合伙企业出资设立。创金合信基金成立以来坚持以客户为中心，倡导合伙文化，致力于为客户提供优质的产品和服务。截至 2024 年 9 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1646.07 亿元。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信软件产业股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信软件产业股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信软件产业股票型发起式证券投资基金 2024 年 3 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日