

创金合信数字经济主题股票型发起式 证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 日

§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.....	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.....	10
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.....	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	12
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.....	13
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
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.....	13
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.....	14
10.3 查阅方式.....	14

§ 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 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信数字经济主题股票
基金主代码	011229
交易代码	011229
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	147,380,051.89 份
投资目标	本基金主要投资于数字经济主题相关股票，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）数字经济主题的界定。数字经济是以数字化的知识、信息为关键性的生产要素，以数字技术为核心驱动力，以现代信息网络为重要载体，通过与传统经济深度融合，实现传统产业转型升级，是一种新型经济形态。数字经济的组成包括两大部分，数字产业化和产业数字化。其中数字产业化是数字经济的基础部分，主要为信息产业，包括电子信息业、基础电信业、互联网行业、软件服务业等；产业数字化主要为国民三大产业（农业、工业、服务业）与数字技术融合的部分，包括传统产业在应用数字技术之后带来的产出增加和效率提

	升。(2) 个股投资策略。(3) 存托凭证的投资策略。(4) 港股通标的股票投资策略。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) 可转换债券和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 800 指数收益率×50%+中证互联网指数收益率×20%+中证港股通科技指数收益率×20%+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。	
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	创金合信数字经济主题股票 A	创金合信数字经济主题股票 C
下属分级基金的交易代码	011229	011230
报告期末下属分级基金的份额总额	76,139,150.89 份	71,240,901.00 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（2021 年 7 月 1 日—2021 年 9 月 30 日）	
	创金合信数字经济主题股票 A	创金合信数字经济主题股票 C
1.本期已实现收益	7,150,675.41	6,028,433.63
2.本期利润	1,958,716.76	1,642,277.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0417	0.0405
4.期末基金资产净值	103,253,215.34	96,277,605.12
5.期末基金份额净值	1.3561	1.3514

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

创金合信数字经济主题股票 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	10.06%	1.36%	-7.47%	1.17%	17.53%	0.19%
过去六个月	25.95%	1.23%	-1.25%	1.06%	27.20%	0.17%
自基金合同生效起至今	35.61%	1.26%	-9.47%	1.21%	45.08%	0.05%

创金合信数字经济主题股票 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	9.92%	1.36%	-7.47%	1.17%	17.39%	0.19%
过去六个月	25.63%	1.23%	-1.25%	1.06%	26.88%	0.17%
自基金合同生效起至今	35.14%	1.26%	-9.47%	1.21%	44.61%	0.05%

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

创金合信数字经济主题股票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01月20日-2021年09月30日)



创金合信数字经济主题股票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



注：1、本基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效，截至报告期末，本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，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		
王浩冰	本基金基金经理	2021 年 1 月 27 日	-	9	王浩冰先生，中国国籍，华盛顿大学硕士，2012 年 7 月加入中信证券股份有限公司研究部，任高级经理，2015 年 6 月加入华商基金管理有限公司研究发展部，任行业研究员，2017 年 9 月加入华泰资产管理有限公司权益投资部，任投资经理助理，2018 年 7 月加入中庚基金管理有限公司，历任投资研究部投资经理助理、投资顾问部任投资经理，2020 年 11 月加入创金合信基金管理有限公司权益投资部任研究员，现任基金经理。
曹春林	本基金基金经理	2021 年 1 月 20 日	-	17	曹春林先生，中国国籍，厦门大学学士，1998 年 7 月就职于中国银河证券，从事研究工作。2004 年 3 月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作。2010 年

				4 月加盟第一创业证券股份有限公司，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。2014 年 8 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

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

2021 年三季度，A 股市场波动较大且分化明显。自 7 月初至 9 月中旬，周期股领涨市场，由于双碳及能耗双控加强的影响，较多的上游周期品供给均面临较强的约束，且部分周期品下游需求强劲，带来了周期品价格的持续上涨，推动周期股的上行；而泛消费类行业由于疫情反复且上游成本上涨，其承受较大压力，出现了不同程度的下跌。9 月中旬后，周期股前期上涨较多，且市场对周期品供给侧的约束力度的预期也有所波动，因此前期领涨

的周期股快速回调；而前期调整较多的泛消费行业在局部疫情逐步受控后基本面边际上有一定改善，股价出现了一定幅度的反弹。

本基金成立以来，我们一直秉持着独立、审慎、进取的投资理念，尽管我们不认为市场过去两年的估值扩张可以一直持续，但市场上仍有很多成长性较好、且估值合理的标的值得挖掘；因此，我们三季度仍然沿着数字化的长期发展方向，积极寻找这一类结构性机会。在操作上，我们重点配置于以下领域：1) 在政策支持、商业模式演进等因素的推动下，部分行业信息化、智能化的进程可能加速，如矿业、泛医疗领域的信息化服务商可能受益于这一趋势性变化；2) 汽车的电动化和智能化将是未来 3-5 年内趋势确定、且同时具有比较大的价值增量的新兴制造领域。3) 线下服务消费在疫情逐步受控后仍有持续修复的空间，且经过本轮供给侧出清后竞争格局进一步改善，同时数字化程度的提升有助于扩展龙头公司的管理半径。4) 在大宗商品价格持续处于高位的情况下，具有竞争优势的龙头开采服务公司可能将受益于相应行业的后续资本开支提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信数字经济主题股票 A 基金份额净值为 1.3561 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.06%，同期业绩比较基准收益率为-7.47%；截至本报告期末创金合信数字经济主题股票 C 基金份额净值为 1.3514 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 9.92%，同期业绩比较基准收益率为-7.47%。

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	163,567,249.56	78.71
	其中：股票	163,567,249.56	78.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,369,924.40	1.14
	其中：债券	2,369,924.40	1.14
	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	30,779,130.74	14.81
8	其他资产	11,103,520.80	5.34
9	合计	207,819,825.50	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 10,113,037.83 元，占净值比为 5.07%。

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	13,894,134.78	6.96
C	制造业	111,808,209.73	56.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,299,875.22	3.16
E	建筑业	6,732,460.00	3.37
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	9,013,363.00	4.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,700.00	0.06
J	金融业	3,542,428.00	1.78
K	房地产业	984,522.00	0.49
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	1,050,519.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	153,454,211.73	76.91

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	3,761,015.98	1.88
信息技术	145,152.37	0.07
电信服务	6,206,869.48	3.11
合计	10,113,037.83	5.07

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	300680	隆盛科技	362,300	9,216,912.00	4.62
2	300057	万顺新材	1,104,000	8,887,200.00	4.45
3	688367	工大高科	387,027	7,581,858.93	3.80
4	603979	金诚信	335,531	7,173,652.78	3.60
5	603678	火炬电子	98,200	6,928,010.00	3.47
6	600258	首旅酒店	315,260	6,872,668.00	3.44
7	002163	海南发展	506,200	6,732,460.00	3.37
8	600905	三峡能源	907,763	6,299,875.22	3.16
9	H00700	腾讯控股	16,148	6,206,869.48	3.11
10	000731	四川美丰	567,800	6,160,630.00	3.09

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	161,128.80	0.08
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）	2,208,795.60	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,369,924.40	1.19

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	127018	本钢转债	14,260	1,697,795.60	0.85
2	113629	泉峰转债	5,110	511,000.00	0.26
3	019649	21 国债 01	1,610	161,128.80	0.08

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

2021 年 1 月 29 日，四川美丰化工股份有限公司（下称“四川美丰”，股票代码：000731）公告于 2021 年 1 月 27 日下午收到渠县监察委员会的《立案通知书》和《留置通知书》，主要内容为：渠县监察委员会决定对公司副总裁王文立案调查；被调查人王文因涉嫌行贿犯罪，对其自 2021 年 1 月 26 日 21 时起实施留置。

本基金投研人员分析认为，在知悉公司副总裁王文被立案调查后，四川美丰公司迅速做出反应，已解聘王文担任的公司副总裁职务。我们认为四川美丰作为一家中央国资企业，预计本次事件对四川美丰的长期竞争力不会造成较大的影响。该公司作为化工类绩优上市公司，主要产品尿素的盈利水平今年以来大幅提升，目前估值处于历史合理位置，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对四川美丰进行了投资。

2021 年 3 月 12 日，腾讯控股（股票代码：0700.HK）因 2018 年 11 月收购猿辅导股权的行为，被国家市场监督管理总局认定为未及时披露公司重大事项，并公开给予腾讯控股 50 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，腾讯控股改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，50 万元罚款对腾讯控股的业绩影响有限。该公司作为互联网行业龙头之一，目前估值处于历史较低位置，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对腾讯控股进行了投资。

2020 年 12 月至 2021 年 3 月期间，金诚信矿业管理股份有限公司（下称“金诚信”，股票代码：603979）因安全生产、税务申报等原因先后受到当地主管部门罚款。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，金诚信公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，上述罚款金额较小，单笔罚款均在 50 万元以下，对业绩影响有限。该公司作为第三方矿业服务龙头之一，目前估值合理，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对金诚信进行了投资。

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	324,988.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,702.10
5	应收申购款	10,769,830.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,103,520.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127018	本钢转债	1,697,795.60	0.85

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	6,299,875.22	3.16	网下申购限售

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信数字经济主题股票 A	创金合信数字经济主题股票 C
报告期期初基金份额总额	33,346,651.94	27,914,035.82
报告期期间基金总申购份额	63,553,428.52	79,490,520.62
减：报告期期间基金总赎回份额	20,760,929.57	36,163,655.44
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	76,139,150.89	71,240,901.00

§ 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	创金合信数字经济主题股票 A	创金合信数字经济主题股票 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,868.22	5,000,868.05
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	5,000,868.22	5,000,868.05
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.57	7.02

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	10,001,736.27	6.79	10,001,736.27	6.79	36 个月
基金管理人高级管理人员	34,163.83	0.02	998.80	0.00	36 个月
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,035,900.10	6.81	10,002,735.07	6.79	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。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。截至 2021 年 9 月 30 日，创金合信基金共管理 74 只公募基金，公募管理规模 686 亿元。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信数字经济主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信数字经济主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信数字经济主题股票型发起式证券投资基金 2021 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

2021 年 10 月 27 日