

创金合信专精特新股票型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 7 月 18 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.....	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.....	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权证投资明细.....	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	9
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.....	11
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	11
§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.....	12
10.2 存放地点.....	12
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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信专精特新股票发起
基金主代码	014736
交易代码	014736
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 26 日
报告期末基金份额总额	216,721,350.98 份
投资目标	本基金主要投资于专精特新主题股票，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	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	中证 1000 指数收益率×80%+中证港股通综合指数收益率（经汇率调整后）×10%+中债综合（全价）指数收益率×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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信专精特新股票发起 A	创金合信专精特新股票发起 C
下属分级基金的交易代码	014736	014737
报告期末下属分级基金的份额总额	78,188,208.51 份	138,533,142.47 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 4 月 1 日—2024 年 6 月 30 日）	
	创金合信专精特新股票发起 A	创金合信专精特新股票发起 C
1.本期已实现收益	-8,174,442.31	-15,920,759.59
2.本期利润	-7,754,638.06	-14,581,861.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0955	-0.0939
4.期末基金资产净值	62,485,533.78	109,375,330.11
5.期末基金份额净值	0.7992	0.7895

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

创金合信专精特新股票发起 A

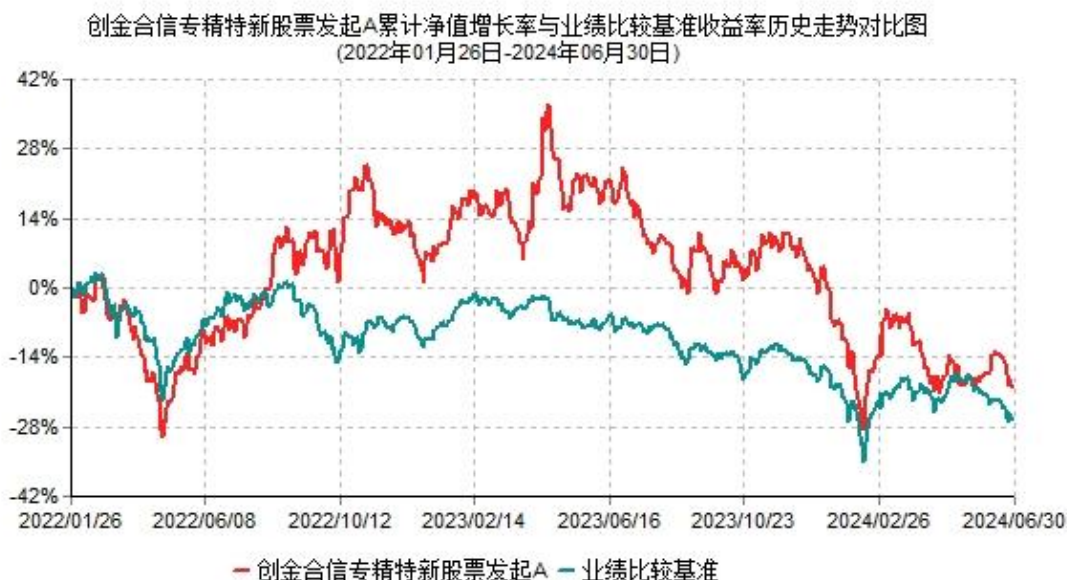
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.22%	1.79%	-7.19%	1.23%	-3.03%	0.56%
过去六个月	-23.25%	2.30%	-12.68%	1.64%	-10.57%	0.66%
过去一年	-35.67%	1.95%	-21.15%	1.30%	-14.52%	0.65%
自基金合同	-20.08%	1.93%	-26.36%	1.24%	6.28%	0.69%

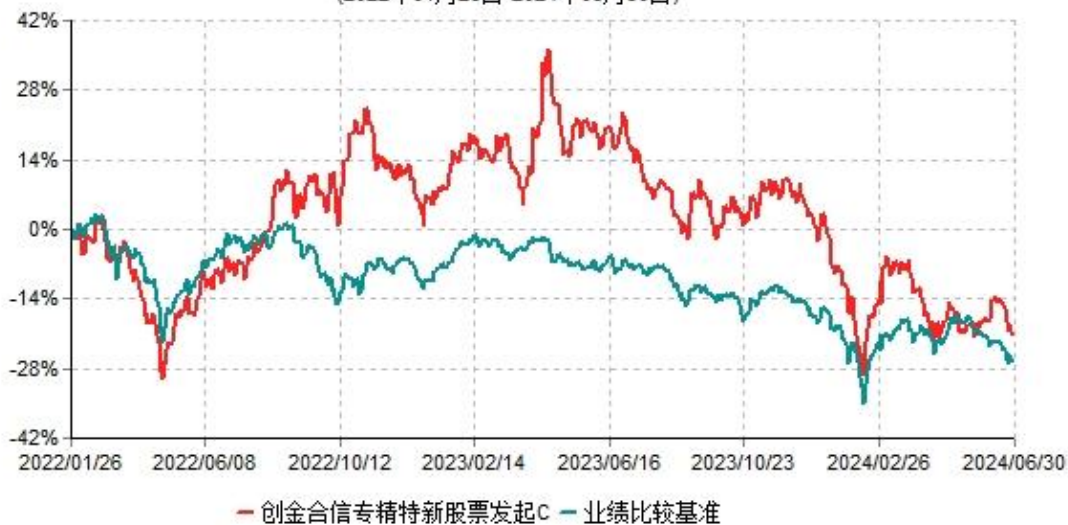
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

创金合信专精特新股票发起 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	-10.35%	1.79%	-7.19%	1.23%	-3.16%	0.56%
过去六个月	-23.45%	2.30%	-12.68%	1.64%	-10.77%	0.66%
过去一年	-36.00%	1.95%	-21.15%	1.30%	-14.85%	0.65%
自基金合同生效起至今	-21.05%	1.93%	-26.36%	1.24%	5.31%	0.69%

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



创金合信专精特新股票发起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01月26日-2024年06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		
王先伟	本基金基金经理	2022年1月26日	-	13	王先伟先生，中国国籍，上海交通大学硕士。2009年7月加入广发基金管理有限公司，任市场部机构理财经理，2011年4月加入华商基金管理有限公司，任市场部机构理财经理，2014年6月加入广发证券资产（广东）有限公司，历任权益产品部行业研究员、投资经理，2020年10月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究员，现任基金经理、兼任投资经理。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
----	------	-------------	---------	------

王先伟	公募基金	2	228,913,495.83	2021-02-26
	私募资产管理计划	1	891,564,347.49	2023-10-20
	其他组合	-	-	-
	合计	3	1,120,477,843.32	-

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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十二条规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人会在十个交易日内进行调整。

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

2024 年二季度市场整体格局相比一季度变化不大，市场主线仍然集中在高股息、出海等主题，并且二季度这些板块也在内部出现较大分化，市场配置越来越集中到高股息的核心资产上，而其他的板块都出现比较明显的调整，整个市场两极分化非常严重。但是我们现在也需要思考一个问题，市场最热的这些高股息是一种热点趋势交易还是真正的高股息投资？每个阶段市场总有一些客观原因造成了对特定因子的极端估值权重，而如果在

趋势的后期进去用这样的思维里面构建组合，可能会在未来很长一段时间都比较被动。而反过来目前一些小盘成长股却处于远低于历史下限的估值水平，这些公司都有着比较强的产业竞争力，报表质量和公司经营也比较正常，但是在市场风格比较极端的时候出现了多年罕见的高性价比位置。

在整个报告期内，本基金的运作延续了一贯的景气成长投资选股体系，在合同约定的国家级“专精特新小巨人”企业榜单中深入研究，选择符合我们选股体系的企业进行投资。本组合重点持有了前道半导体工艺设备及核心零部件、新材料、智能汽车零部件、先进封装设备等行业中的优秀专精特新企业。我们在二季度积极跟踪组合持仓的个股基本面，从最新的产业进展和公司经营业绩的判断来做出了组合的调整，增持了智能汽车零部件、新材料等行业，减持了医疗。

从投资理念来说，本基金是一个中小盘主题成长风格基金，我们的投资标的范围严格限定在工信部的国家级专精特新“小巨人”企业榜单里面。因此，本基金未来的风格和持仓特点也会延续专精特新的风格。专精特新企业是新时代的经济发展的坚实支撑，也是科技和高端制造业供应链安全和国家安全的重要组成部分，是新型举国体制的重要载体。我们认为专精特新企业面临巨大的国产替代蓝海市场，具备非常好的长期投资前景。未来我们仍然将践行景气成长的选股体系，在专精特新板块里面寻找空间大、行业格局好、估值合理的优质企业，保持本基金的中小盘成长风格。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信专精特新股票发起 A 基金份额净值为 0.7992 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.22%，同期业绩比较基准收益率为-7.19%；截至本报告期末创金合信专精特新股票发起 C 基金份额净值为 0.7895 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.35%，同期业绩比较基准收益率为-7.19%。

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	160,204,578.18	92.91

	其中：股票	160,204,578.18	92.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	11,953,412.16	6.93
8	其他资产	270,881.14	0.16
9	合计	172,428,871.48	100.00

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	160,204,578.18	93.22
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	-	-
J	金融业	-	-
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	160,204,578.18	93.22

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300567	精测电子	305,485	17,262,957.35	10.04
2	002371	北方华创	53,000	16,954,170.00	9.87
3	688630	芯碁微装	265,191	16,593,000.87	9.65
4	300820	英杰电气	408,369	16,065,236.46	9.35
5	688120	华海清科	84,262	15,974,389.96	9.29
6	688072	拓荆科技	132,457	15,909,410.27	9.26
7	688037	芯源微	173,691	15,458,499.00	8.99
8	603283	赛腾股份	113,000	8,633,200.00	5.02
9	832978	开特股份	721,860	6,864,888.60	3.99
10	833394	民士达	467,100	6,539,400.00	3.81

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州赛腾精密电子股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到苏州市吴中区消防救援大队处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	139,878.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	131,002.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	270,881.14

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	创金合信专精特新股票发起 A	创金合信专精特新股票发起 C
报告期期初基金份额总额	88,321,526.02	180,177,054.25
报告期期间基金总申购份额	5,088,489.88	19,940,410.62
减：报告期期间基金总赎回 份额	15,221,807.39	61,584,322.40
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	78,188,208.51	138,533,142.47

§ 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	创金合信专精特新股票发起 A	创金合信专精特新股票发起 C
报告期期初管理人持有的本 基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例（%）	6.39	3.61

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	发起份额总数	发起份额占	发起份额承
----	--------	-------	--------	-------	-------

		基金总份额 比例 (%)		基金总份额 比例 (%)	诺持有期限
基金管理人 固有资金	10,000,000.00	4.61	10,000,000.00	4.61	36 个月
基金管理人 高级管理人员	106,665.80	0.05	-	-	-
基金经理等 人员	2,661,859.36	1.23	1,068,717.54	0.49	36 个月
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	12,768,525.16	5.89	11,068,717.54	5.11	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 6 月 30 日，创金合信基金共管理 99 只公募基金，公募管理规模 1615.63 亿元。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《创金合信专精特新股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信专精特新股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信专精特新股票型发起式证券投资基金 2024 年 2 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 7 月 18 日