

创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金 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：华夏银行股份有限公司

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..... | 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 5 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 5 |
| 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析..... | 5 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 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..... | 6 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 6 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 7 |
| 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..... | 7 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 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..... | 8 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 8 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 9 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 9 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 9 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 10 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 10 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 10 |
| §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况..... | 10 |
| §9 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 9.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| §10 备查文件目录..... | 11 |
| 10.1 备查文件目录..... | 11 |
| 10.2 存放地点..... | 11 |
| 10.3 查阅方式..... | 11 |

§ 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。

基金托管人华夏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 | 创金合信气候变化责任投资股票 | |
| 基金主代码 | 011146 | |
| 交易代码 | 011146 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 30 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 225,217,954.77 份 | |
| 投资目标 | 本基金主要通过精选气候变化责任投资主题相关证券，在合理控制风险的前提下，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 800 指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×10%+恒生指数收益率×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。 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信气候变化责任投资股票 A | 创金合信气候变化责任投资股票 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011146 | 011147 |

| | | |
|---------------------|-----------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 97,104,128.10 份 | 128,113,826.67 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（2023 年 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日） | |
|--------------------|---------------------------------------|----------------------|
| | 创金合信气候变化责任投资 股票 A | 创金合信气候变化责任投资 股票 C |
| 1.本期已实现收益 | -1,480,627.10 | -1,983,363.61 |
| 2.本期利润 | 2,200,612.67 | 2,738,589.29 |
| 3.加权平均基金份额本期利 润 | 0.0245 | 0.0237 |
| 4.期末基金资产净值 | 93,975,200.00 | 122,504,881.55 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9678 | 0.9562 |

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

创金合信气候变化责任投资股票 A

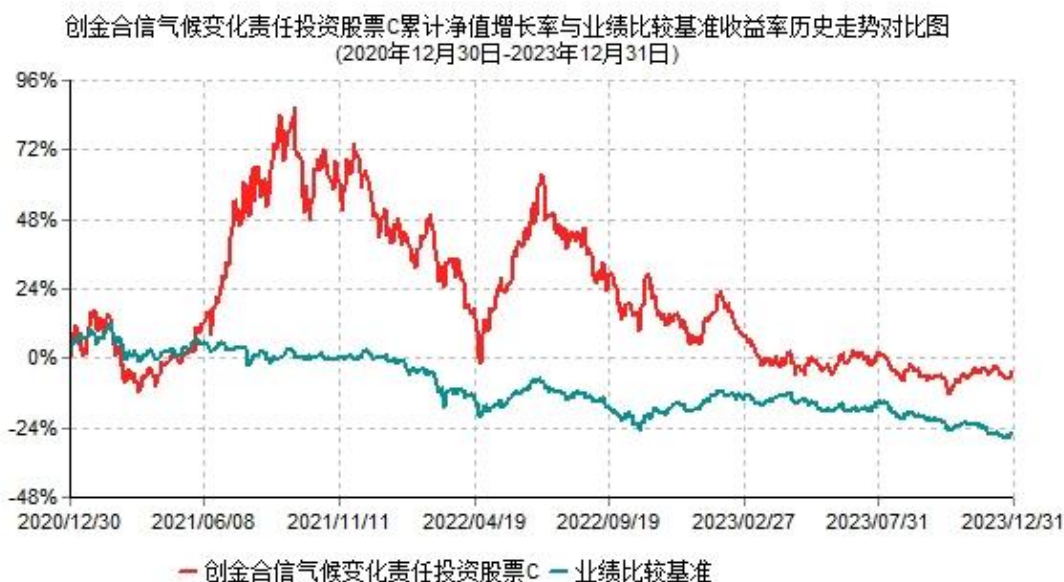
| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值增 长率标准差 ② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.48% | 1.05% | -5.42% | 0.72% | 7.90% | 0.33% |
| 过去六个月 | -4.95% | 1.07% | -9.18% | 0.76% | 4.23% | 0.31% |
| 过去一年 | -8.87% | 1.25% | -9.38% | 0.75% | 0.51% | 0.50% |
| 过去三年 | -4.46% | 2.17% | -27.34% | 0.97% | 22.88% | 1.20% |
| 自基金合同 生效起至今 | -3.22% | 2.16% | -25.30% | 0.97% | 22.08% | 1.19% |

创金合信气候变化责任投资股票 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 | 2.37% | 1.05% | -5.42% | 0.72% | 7.79% | 0.33% |
| 过去六个月 | -5.15% | 1.07% | -9.18% | 0.76% | 4.03% | 0.31% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | -9.24% | 1.25% | -9.38% | 0.75% | 0.14% | 0.50% |
| 过去三年 | -5.61% | 2.16% | -27.34% | 0.97% | 21.73% | 1.19% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.38% | 2.16% | -25.30% | 0.97% | 20.92% | 1.19% |

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



§ 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 | | |
| 寸思敏 | 本基金基金经理 | 2023 年 4 月 29 日 | - | 7 | 寸思敏女士，中国国籍，上海财经大学硕士。2016 年 7 月加入招商证券股份有限公司，担任汽车行业高级分析师，2021 年 10 月加入创金合信基金管理有限公司，曾任风格策略投资部基金经理助理，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《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

市场经过前期调整目前处于相对的底部区间，不具备大幅调整前提，产品配置思路仍以寻找自下而上结构性机会为主。

产品致力于自下而上寻找三类资产，中早期成长股、独立成长股和周期成长股。中早期成长股是指在中早期产业趋势里能够长大的公司，具备相对较大的市场空间、在早期具备差异化的竞争优势；独立成长股是指在市场关注相对低的领域去寻找未被发现、具备成长性、相对低估的公司；周期成长股我们倾向于在景气度下行进入最后阶段、同时定价处于历史相对底部的板块中去寻找中期有成长的公司。

2023 年年报持仓和未来重点关注方向：聚焦高端制造、科技成长、周期三大板块。未来我们依旧看好这三大方向，通过比较研究，自下而上寻找持续成长、定价合理的公司，通过分析企业成长的红利，实现中期的稳定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信气候变化责任投资股票 A 基金份额净值为 0.9678 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.48%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%；截至本报告期末创金合信气候变化责任投资股票 C 基金份额净值为 0.9562 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.37%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%。

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

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 | 177,355,528.56 | 78.80 |
| | 其中：股票 | 177,355,528.56 | 78.80 |
| 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 | 43,546,492.73 | 19.35 |
| 8 | 其他资产 | 4,166,266.96 | 1.85 |
| 9 | 合计 | 225,068,288.25 | 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 2,515,699.89 元，占净值比为 1.16%。

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 | 10,786,626.69 | 4.98 |
| B | 采矿业 | 5,084,926.00 | 2.35 |
| C | 制造业 | 141,720,995.07 | 65.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 17,897.04 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 303,077.23 | 0.14 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 725,868.00 | 0.34 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,352,176.35 | 1.09 |
| J | 金融业 | 1,854,203.40 | 0.86 |
| K | 房地产业 | 1,998,708.00 | 0.92 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,909,325.55 | 0.88 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 175,089.08 | 0.08 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 15,792.26 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 7,895,144.00 | 3.65 |
| | 合计 | 174,839,828.67 | 80.76 |

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（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料 | 1,579,541.46 | 0.73 |
| 非日常生活消费品 | 936,158.43 | 0.43 |
| 合计 | 2,515,699.89 | 1.16 |

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 | 002920 | 德赛西威 | 64,912 | 8,406,753.12 | 3.88 |
| 2 | 002840 | 华统股份 | 384,482 | 7,993,380.78 | 3.69 |
| 3 | 600603 | 广汇物流 | 1,014,800 | 7,895,144.00 | 3.65 |
| 4 | 603477 | 巨星农牧 | 167,600 | 6,279,972.00 | 2.90 |
| 5 | 002215 | 诺普信 | 688,600 | 5,687,836.00 | 2.63 |
| 6 | 000400 | 许继电气 | 256,200 | 5,626,152.00 | 2.60 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 408,100 | 5,084,926.00 | 2.35 |
| 8 | 301363 | 美好医疗 | 116,000 | 4,268,800.00 | 1.97 |
| 9 | 002011 | 盾安环境 | 299,700 | 4,120,875.00 | 1.90 |
| 10 | 600435 | 北方导航 | 349,200 | 4,099,608.00 | 1.89 |

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

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 | 373,408.16 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,792,858.80 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,166,266.96 |

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 | 创金合信气候变化责任投资股票 A | 创金合信气候变化责任投资股票 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 91,093,806.48 | 117,878,561.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,139,025.20 | 19,225,035.93 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,128,703.58 | 8,989,770.49 |
| 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 | 97,104,128.10 | 128,113,826.67 |

§ 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 | 创金合信气候变化责任投资股票 A | 创金合信气候变化责任投资股票 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 | 5,765,964.14 | - |
| 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 | 10,765,964.14 | 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（%） | 11.09 | 3.90 |

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 12 月 28 日 | 5,765,964.14 | 5,500,000.00 | 0.02% |
| 合计 | - | - | 5,765,964.14 | 5,500,000.00 | - |

§ 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 | 15,765,964.14 | 7.00 | 10,000,000.00 | 4.44 | 36 个月 |
| 基金管理人 | 14,578.78 | 0.01 | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|---------------|------|---------------|------|-------|
| 高级管理人员 | | | | | |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 15,780,542.92 | 7.01 | 10,000,000.00 | 4.44 | 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。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、《创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信气候变化责任投资股票型发起式证券投资基金 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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日