

创金合信资源主题精选股票型发起式证券投资基金

2017年第1季度报告

2017年03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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017年04月21日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月18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2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	创金合信资源主题精选股票
基金主代码	003624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月02日
报告期末基金份额总额	14,779,025.39份
投资目标	本基金主要投资精选的资源主题股票，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	本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架，基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法，综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素，形成各资产类别预期收益与预期风险的判断，并进而确定股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。
业绩比较基准	中证内地资源指数收益率×90%+人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均预期风险与预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信资源主题精选股票A	创金合信资源主题精选股票C
下属分级基金的交易代码	003624	003625
报告期末下属分级基金的份额总额	6,788,757.63份	7,990,267.76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（2017年01月01日-2017年03月31日）	
	创金合信资源主题精选股票A	创金合信资源主题精选股票C
1. 本期已实现收益	30,317.26	27,270.33
2. 本期利润	213,293.44	136,593.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0307	0.0178
4. 期末基金资产净值	6,794,181.23	7,984,191.99
5. 期末基金份额净值	1.0008	0.9992

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

创金合信资源主题精选股票A

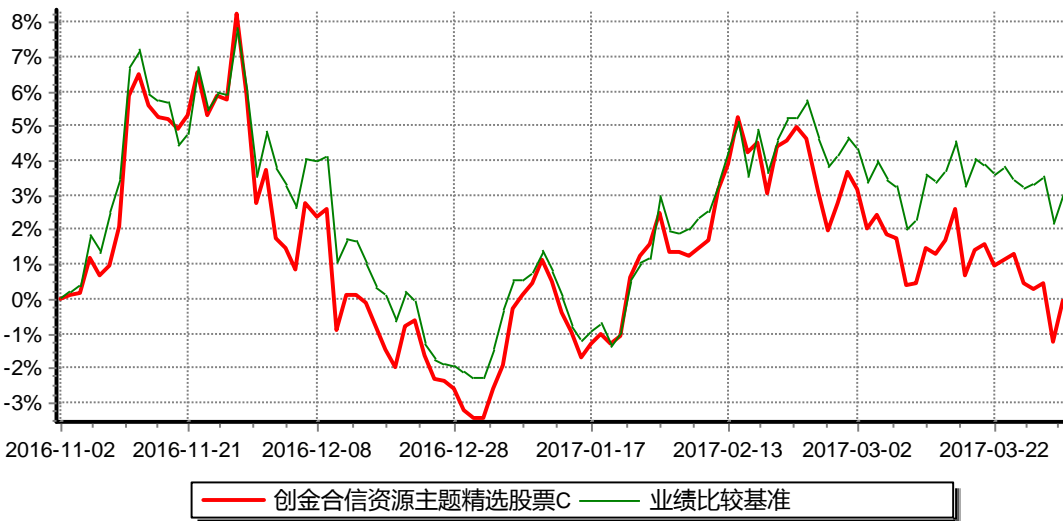
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	3.60%	0.85%	5.50%	0.76%	-1.90%	0.09%
-------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

创金合信资源主题精选股票C

阶段	净值增长率①	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	3.49%	0.85%	5.50%	0.76%	-2.01%	0.09%

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：截至报告期末，本基金仍处于建仓期内。

§ 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		
李游	基金经理	2016年11月02日	—	9	李游先生，中国国籍，中南财经政法大学金融学硕士，曾在五矿期货有限公司、华创证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司任研究员，2014年8月加入创金合信基金管理有限公司任研究部行业研究员，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公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》和《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金采取自上而下的投资策略，通过宏观景气度分析和行业供需边际变化分析来配置行业。相对中证内地资源指数的行业权重配置，本基金超配石油、铜、铝和钢铁行业，低配黄金、铅锌和稀土等行业，煤炭行业配置权重与指数相当，重点配置央企和山西国改个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，创金合信资源主题A和创金合信资源主题C的净值增长率分别为3.60%和3.49%，同期业绩比较基准收益率为5.50%。

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,369,654.54	87.97
	其中：股票	13,369,654.54	87.97
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	1,726,392.54	11.36
8	其他资产	102,770.68	0.68
9	合计	15,198,817.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	6,653,685.96	45.02
C	制造业	6,715,968.58	45.44
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	13,369,654.54	90.47

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	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	243,559	1,398,028.66	9.46
2	601857	中国石油	148,780	1,170,898.60	7.92
3	601600	中国铝业	243,391	1,131,768.15	7.66
4	000983	西山煤电	78,100	753,665.00	5.10
5	000778	新兴铸管	131,200	713,728.00	4.83
6	601088	中国神华	32,450	628,232.00	4.25
7	000709	河钢股份	164,127	592,498.47	4.01
8	600362	江西铜业	32,546	561,418.50	3.80
9	000878	云南铜业	38,820	543,868.20	3.68
10	000807	云铝股份	73,726	538,199.80	3.64

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

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序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序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序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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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受到监管部门立案调查，或在编制日前一年内受到公开谴责、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股票备选库的情况。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,927.23
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	248.77
5	应收申购款	91,594.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	102,770.68

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

	创金合信资源主题精	创金合信资源主题精选股
--	-----------	-------------

	选股票A	票C
报告期期初基金份额总额	6,769,470.44	6,261,272.79
报告期期间基金总申购份额	1,671,799.28	5,643,530.78
减：报告期期间基金总赎回份额	1,652,512.09	3,914,535.81
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	6,788,757.63	7,990,267.76

§ 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

	创金合信资源主题精 选股票A	创金合信资源主题精 选股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,200.04	5,000,200.00
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	5,000,200.04	5,000,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	73.65	62.58

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	10,000,400.04	67.67%	10,000,400.04	67.67%	36月
基金管理人高级管	—	—	—	—	

理人员					
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,400.04	67.67%	10,000,400.04	67.67%	

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、创金合信资源主题精选股票型发起式证券投资基金基金合同；
- 2、创金合信资源主题精选股票型发起式证券投资基金托管协议；
- 3、创金合信资源主题精选股票型发起式证券投资基金2017年第一季度报告原文

10.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年四月二十一日