
创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金

2018年第1季度报告

2018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:2018年04月19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2018年04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2018年01月01日起至2018年03月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信科技成长股票
基金主代码	005495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月28日
报告期末基金份额总额	11,998,171.04份
投资目标	本基金主要投资于预期成长性良好的科技行业股票，通过对行业景气周期的判断和个股精选，追求超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。
业绩比较基准	中证高新技术企业指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金

	。	
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	创金合信科技成长股票 A	创金合信科技成长股票 C
下属分级基金的交易代码	005495	005496
报告期末下属分级基金的份额总额	5,721,625.96份	6,276,545.08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(2018年01月01日 - 2018年03月31日)	
	创金合信科技成长股票A	创金合信科技成长股票C
1. 本期已实现收益	-269,886.12	-269,968.25
2. 本期利润	243,116.81	279,687.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0453	0.0524
4. 期末基金资产净值	5,968,371.31	6,540,610.54
5. 期末基金份额净值	1.0431	1.0421

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

创金合信科技成长股票A净值表现

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	4.27%	1.93%	6.83%	1.93%	-2.56%	-

创金合信科技成长股票C净值表现

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	4.17%	1.93%	6.83%	1.93%	-2.66%	-

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：1、本基金的基金合同于 2017 年 12 月 28 日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，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（第十三部分二、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。

§ 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		
周志敏	本基金经理	2017-12-28	-	6年	周志敏先生，中国国籍，清华大学学士，中国科学院研究生院博士。历任广发证券股份有限公司研究员，第一创证券股份有限公司研究员，从事行业研究工作。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司从事行业研究工作，投资工作，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遵规守信情况说明

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。本基金的投资范围、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

本基金主要投资于预期成长性良好的科技行业股票。本基金的投资策略是通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，从定性和定量两个角度精选出发展前景良好或景气程度向好的行业，进行重点配置。定性分析层面，本基金以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。定量分析层面，本基金拟从各项财务指标和估值指标多维度综合判断行业景气度，指标数值较高的行业将是本基金的投资重点。综合定性和定量分析结果，本基金将确定不同行业的配置比例，并通过对经济周期、行业周期和行业景气度的持续跟踪，动态调整行业配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信科技成长股票A基金份额净值为1.0431元;本报告期内,基金份额净值增长率为4.27%,同期业绩比较基准收益率为6.83%;截至报告期末创金合信科技成长股票C基金份额净值为1.0421元;本报告期内,基金份额净值增长率为4.17%,同期业绩比较基准收益率为6.83%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,642,058.00	92.48
	其中:股票	11,642,058.00	92.48
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	900,395.65	7.15
8	其他资产	45,606.27	0.36
9	合计	12,588,059.92	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	7,157,894.00	57.22
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	4,484,164.00	35.85
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	11,642,058.00	93.07

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

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	002465	海格通信	87,800	926,290.00	7.40
2	002371	北方华创	20,100	921,987.00	7.37
3	002376	新北洋	53,600	915,488.00	7.32
4	300059	东方财富	53,400	904,062.00	7.23
5	600584	长电科技	40,500	880,470.00	7.04
6	300047	天源迪科	54,700	875,200.00	7.00

7	600521	华海药业	26,300	862,377.00	6.89
8	300408	三环集团	30,200	728,726.00	5.83
9	600570	恒生电子	11,500	687,470.00	5.50
10	600845	宝信软件	22,800	631,332.00	5.05

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2017年8月16日、2017年8月26日、2018年3月10日，恒生电子股份有限公司（以下简称“恒生电子”）分别发布《关于控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司所涉行政处罚事宜的进展公告》，公告称恒生网络已无法正常持续经营，处于净资产不足以偿付《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（[2016]123号）所涉罚没款的状态。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，恒生电子迅速做出反应，积极整改，及时停止了违规子公司的相关经营业务，并且于2015 至 2016 年度累计预提罚没支出

439,467,490.68元，未来对上市公司层面的业绩影响有限。2017年公司收入和利润分别增长22.85%和2476.18%。该公司作为金融IT行业龙头之一，受益于资管新规等行业变化，目前业绩处于复苏态势，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恒生电子进行了投资。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,647.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	344.92
5	应收申购款	39,613.93
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	45,606.27

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

	创金合信科技成长股票 A	创金合信科技成长股票 C
报告期期初基金份额总额	5,274,112.42	5,083,700.24
报告期期间基金总申购份额	704,347.49	1,631,715.46
减：报告期期间基金总赎回份额	256,833.95	438,870.62
报告期期间基金拆分变动份额（ 份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	5,721,625.96	6,276,545.08

§ 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

	创金合信科技成长股票A	创金合信科技成长股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,900.18	5,000,900.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	87.40	79.68

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	10,001,800.18	83.36	10,001,800.18	83.36	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	10,001,800.18	83.36	10,001,800.18	83.36	36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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101 - 20180331	10,001,800.18	0.00	0.00	10,001,800.18	83.36%

产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

1、大额申购风险

在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；

(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；

(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

9.2 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、《创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信科技成长主题股票型发起式证券投资基金2018年第1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
二〇一八年四月十九日