
创金合信工业周期精选股票型发起式证券投资基金

2018 年第 3 季度报告

2018 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2018 年 10 月 25 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 |
| 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 | 3 |
| 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 |
| §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 | 5 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 6 |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况 | 6 |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明 | 6 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 6 |
| 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 | 8 |
| 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序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序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 | 9 |
| 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 | 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 | 9 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 9 |
| §6 开放式基金份额变动 | 10 |
| §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 | 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 | 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 | 12 |

§ 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10月24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07月01日起至2018年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 创金合信工业周期股票 |
| 基金主代码 | 005968 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年05月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,112,261.01份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于工业周期主题股票，通过行业配置与个股精选策略，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 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 | 中证工业指数收益率*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，长期来看，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、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 | 创金合信工业周期股票 A | 创金合信工业周期股票 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005968 | 005969 |
| 报告期末下属分级基金的份额 总额 | 5,024,097.48份 | 5,088,163.53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07月01日 - 2018年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|-----------------|
| | 创金合信工业周期股 票A | 创金合信工业周期股 票C |
| 1. 本期已实现收益 | -227,864.12 | -238,608.86 |
| 2. 本期利润 | -172,789.76 | -182,310.30 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0345 | -0.0359 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,368,163.75 | 4,412,320.85 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8694 | 0.8672 |

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

创金合信工业周期股票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 | -3.82% | 1.29% | -4.00% | 1.13% | 0.18% | 0.16% |

创金合信工业周期股票C净值表现

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|-------|-----|-----|
|----|------|------|------|-------|-----|-----|

| | 率① | 率标准差 ② | 基准收益 率③ | 准收益率标 准差④ | | |
|-----------|--------|-----------|------------|--------------|-------|-------|
| 过去三个 月 | -3.98% | 1.29% | -4.00% | 1.13% | 0.02% | 0.16% |

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 2018 年 5 月 17 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。



§ 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 | 本基金 基金经 理 | 2018-05 -17 | - | 11 | 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

报告期内本基金重点配置机械、军工、电力设备新能源等几个行业，并通过对细分行业景气度的分析来选股。机械重点配置了工程机械及配套液压设备、高空设备、半导体设备、油气设备；军工重点配置主机厂和元器件龙头；电力设备新能源重点配置风电、低压电器、锂电池和特高压龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信工业周期股票A基金份额净值为0.8694元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.82%，同期业绩比较基准收益率为-4.00%；截至报告期末创金合信工业周期股票C基金份额净值为0.8672元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.98%，同期业绩比较基准收益率为-4.00%。

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 | 7,454,163.94 | 84.07 |
| | 其中：股票 | 7,454,163.94 | 84.07 |
| 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 | 1,406,566.76 | 15.86 |
| 8 | 其他资产 | 6,392.14 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 8,867,122.84 | 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) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 241,332.00 | 2.75 |
| C | 制造业 | 6,850,614.94 | 78.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 362,217.00 | 4.13 |
| 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 | 7,454,163.94 | 84.89 |

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 | 603338 | 浙江鼎力 | 9,900 | 536,580.00 | 6.11 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 60,200 | 534,576.00 | 6.09 |
| 3 | 002202 | 金风科技 | 41,000 | 492,410.00 | 5.61 |
| 4 | 601100 | 恒立液压 | 21,700 | 484,561.00 | 5.52 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 6,300 | 459,900.00 | 5.24 |
| 6 | 000400 | 许继电气 | 47,200 | 435,656.00 | 4.96 |
| 7 | 603799 | 华友钴业 | 7,140 | 380,490.60 | 4.33 |
| 8 | 002179 | 中航光电 | 7,600 | 334,400.00 | 3.81 |
| 9 | 300470 | 日机密封 | 12,820 | 322,679.40 | 3.67 |
| 10 | 002353 | 杰瑞股份 | 12,997 | 283,074.66 | 3.22 |

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 2018 年 6 月 6 日烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司（以下简称“公司”或“杰瑞股份”）收到烟台市公安局莱山分局出具的《立案决定书》（烟莱公（经）立字[2018]206 号），易湘琢、韦江等人因涉嫌合同诈骗被立案侦查，目前案件正在侦查过程中。

本基金投研人员分析认为，此事项对公司影响已经基本消除。2018年9月18日，公司公告，杰瑞环保已全额收回湖南先瑞原股东易湘琢、北京青盟投资有限公司、北京青盟天使投资中心（有限合伙）不当所得投资款、相应的资金占用利息及违约金合计 123,443,872.94 元。公司将收回的投资款冲减长期股权投资，资金占用利息计入财务费用，违约金计入营业外收入，最终会计处理以审计机构年度审计确认后的结果为准。本事项不会对公司 2018 年度收入及净利润产生重大影响。该公司作为油服行业龙头之一，随着油价持续高位和国内政策推动，目前处于行业景气上升阶段，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杰瑞股份进行了投资。

三一重工股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）近日查询到公司副总裁谢志霞先生违规买卖公司股票。公司副总裁谢志霞先生于 2017 年 8 月 30 日至 11 月 2 日累计买入公司股票 23,600 股，并于 2017 年 11 月 10 日全部卖出。违反了《证券法》第四十七条及《上海证券交易所股票上市规则》第 3.1.7 条的相关规定，在六个月内买入公司股票又卖出的行为构成短线交易。违反了《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》第十三条的规定，构成违规减持，未尽到交易报备及预披露责任。

本基金投研人员分析认为，此事项对公司影响已经基本消除。公司董事会知悉此事后高度重视，及时了解相关情况，谢志霞先生也积极配合公司调查。经综合考虑，公司董事会对谢志霞先生违规买卖公司股票的行为做出如下处理决定：1、对谢志霞先生的违规买卖股票行为进行了严厉的批

评教育； 2、没收本次违规买卖股票所得收益人民币 13,659 元，并处以 5,000 元人民币罚款。谢志霞先生已深刻认识到本次违规事项的严重性，并就本次违规行为向广大投资者致以诚挚的歉意。本事项不会对公司2018年度收入及净利润产生重大影响。公司是工程机械龙头，市占率不断提升，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三一重工进行了投资。

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 | 4,664.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 279.06 |
| 5 | 应收申购款 | 1,448.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,392.14 |

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

| | 创金合信工业周期股票 A | 创金合信工业周期股票 C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,001,219.28 | 5,031,951.47 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 30,260.99 | 78,973.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,382.79 | 22,761.70 |
| 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 | 5,024,097.48 | 5,088,163.53 |
|-------------|--------------|--------------|

§ 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

| | 创金合信工业周期股票A | 创金合信工业周期股票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 | 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 | 5,000,000.00 | 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 (%) | 99.52 | 98.27 |

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 | 10,000,000.00 | 98.89% | 10,000,000.00 | 98.89% | 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 | 10,000,000.00 | 98.89% | 10,000,000.00 | 98.89% | 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 | 20180701 - 20180930 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 98.89% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

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、《创金合信工业周期精选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信工业周期精选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信工业周期精选股票型发起式证券投资基金2018年第3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层

10.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

2018年10月25日