

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 2019-04-22

重要提示

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,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并承诺为基金份额持有人提供优质服务。
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,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并承诺为基金份额持有人提供优质服务。
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,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并承诺为基金份额持有人提供优质服务。

基金基本情况

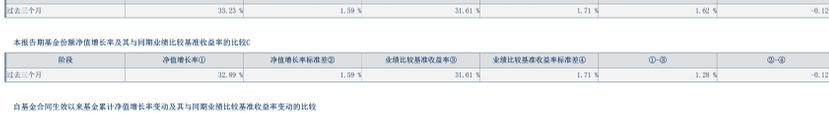
Table with 2 columns: Item (项目) and Value (数值). Includes details like fund name, code, and investment strategy.

主要财务指标

Table with 4 columns: Main Financial Indicators (主要财务指标), Fund Assets (主基金(元)), Fund Assets (创金合信中证1000增强A(元)), and Fund Assets (创金合信中证1000增强C(元)).

基金业绩表现

Table comparing performance metrics: Net Growth Rate (净值增长率), Benchmark (净值增长率基准), etc.



其他指标

Table with 2 columns: Other Indicators (其他指标) and Values (数值).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table listing fund managers with columns for Name (姓名), Position (职务), Appointment Date (任职日期), and Remarks (说明).

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、基金合同和基金法律文件的约定,诚实信用,勤勉尽责,严格按照法律法规和行业自律规范运作,切实维护基金份额持有人的合法权益。

公平交易专项说明

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),通过建立有效内控、规范化的投资管理流程和决策流程,确保投资决策过程的公平、公正、公开,严格执行公平交易制度,切实防范利益输送。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

异常交易行为的专项说明
本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,本基金与管理人管理的其他投资组合出现同日反向交易成交的单一证券超过该证券当日成交量的5%的交易共3次。本基金量化投资策略基金,发生反向交易行为的原因:基金在持仓点位,多个投资组合在少数股票上产生分歧,产生了反向交易信号而引发的交易,交易时间接近交易,完全为偶然成交,未对当期投资组合产生冲击。

报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年一季度,我们继续在底部区域进行投资,并严格执行风险控制。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证1000增强A基金份额净值为0.9939元,本报告期内,该基金份额净值增长率为33.23%,同期业绩比较基准收益率为31.61%;截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为0.9882元,本报告期内,该基金份额净值增长率为32.89%,同期业绩比较基准收益率为31.61%。

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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition by asset type: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%).

报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

Table showing industry breakdown of index investment: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table showing industry breakdown of active investment: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table listing top 10 stocks by fair value: 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(%).

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

Table listing top 5 bonds by fair value: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio by type: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table listing top 5 bonds by fair value: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table listing top 10 asset-backed investments by fair value: 序号, 资产名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table listing top 5 precious metal investments by fair value: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table listing top 5 warrant investments by fair value: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table showing derivatives investment: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 公允价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明.

本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货,均以套期保值为目的,本季度进行了少量套期保值操作。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货交易政策
报告期末本基金投资的国债期货交易明细
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

投资组合报告附注

受到谴责以及处罚情况
2019年7月20日,江西正邦科技股份有限公司(下称正邦科技,股票代码:002157)下属子公司肇庆正邦养殖有限公司收到肇庆市环境保护局出具的《行政处罚决定书》(肇环行〔2018〕0605号)。

申明基金投资的前十名股票是否涉及基金合同约定的备选股票程序
本报告期内,未出现基金投资的前十名股票涉及基金合同约定的备选股票的情形。

Table showing other assets: 序号, 名称, 金额(元).

Table showing convertible bonds: 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细.

Table showing convertible bonds: 报告期末前十名投资中存在流通受限情况的说明.

Table showing open-ended fund assets: 项目, 创金合信中证1000增强A, 创金合信中证1000增强C.

Table showing fund manager assets: 基金管理人持有本基金份额变动情况.

Table showing fund manager assets: 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.

Table showing fund manager assets: 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.

Table showing fund manager assets: 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.

影响投资决策的其他重要信息
本报告期内,未出现影响投资决策的其他重要信息。

备查文件目录
1、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》;
3、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年第1季度报告》。