

创金信优选回报灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：创金信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，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失...

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, etc.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31). Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

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... 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...

基金净值表现

Table showing 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. Includes columns for 阶段, 净值增长率, etc.



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31). Includes 基金份额持有人数量, etc.

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理任期 (Term), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks). Lists 陈玉智 as the manager.

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... 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》的相关规定。

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...

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《证券投资基金管理人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，强化事后监控和分析等手段...

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度市场呈现全面快速回升走势，上证50、沪深300、中证2000、创业板指等代表性强大小市值风格一季度涨幅均达到24%-35%。基金组合一季度维持了低市值、低估值、国企股风格策略...

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金信优选回报混合基金份额净值为1.0316元，本报告期内，基金份额净值增长率为14.47%，同期业绩比较基准收益率为8.37%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满一百人或基金资产净值低于五千万的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists 权益类投资, 固定收益投资, etc.

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists 农林牧渔, 采矿业, etc.

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 with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists 特变电工, 长江传媒, etc.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists 国债, 央行票据, etc.

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 with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with 4 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with 4 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with 4 columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

受到调查以及处罚情况：四川美丰化工股份有限公司（以下简称“公司”）于12月1日公告收到四川省美丰化工科技有限责任公司（以下简称“美丰科技”）转来绵阳市环境保护局的《行政处罚决定书》...

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库：本报告期内，未发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。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Lists 应收证券清算款, 应收股利, etc.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细：注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明：注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额持有人数量, etc.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Includes 报告期初管理人持有的本基金份额, 报告期末管理人持有的本基金份额, etc.

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Shares), 交易金额 (元) (Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Holding Period for Initiated Shares).

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval for Holding Share Proportion Reaching or Exceeding 20%), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Proportion).

注：本基金在报告期内不存在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。

备查文件目录：1. 《创金信优选回报灵活配置混合型证券投资基金合同》；2. 《创金信优选回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；3. 创金信优选回报灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告原文。

存放地点：深圳市福田区中心区福强一路115号投行大厦10楼

查阅方式：www.cifund.com