

目录
重要提示
基金管理人承诺
基金托管人承诺
重要风险提示
基金业绩
基金管理人承诺
基金托管人承诺
重要风险提示
基金业绩

重要提示

基金管理人承诺及重要提示：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法律责任。
基金托管人承诺：基金托管人承诺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法律责任。

基金基本情况
基金名称：创金合信国证1000指数
基金简称：创金国证1000
基金代码：005953
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2018-02-07
报告期末基金份额总额：10,456,278.75
投资目标：紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略：正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。

主要财务指标

主要财务指标
主要财务指标：本期已实现收益 -18,599.81; 本期利润 1,169,480.8; 加权平均基金份额本期利润 0.2168; 期末基金份额净值 5.282,202.02; 期末基金资产净值 5,509,148.17

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。

基金净值表现

基金净值表现
阶段：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
阶段：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A
阶段：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B

自基金合同生效以来基金业绩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
自基金合同生效以来基金业绩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A
自基金合同生效以来基金业绩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B



注：本基金的基金合同于2018年2月7日生效，本基金的建仓期为6个月，建仓期结束前各资产配置比例符合合同约定。

其他指标

其他指标
其他指标：本报告期(2019-01-01至2019-03-31) 报告期末(2019-03-31)

基金经理(或基金经理小组)简介

基金经理(或基金经理小组)简介
姓名：陈亮
职务：本基金基金经理
任职日期：2018-02-07
离任日期：-
证券从业年限：11年
说明：陈亮先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校(UCLA)金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研究员高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指期货高级研究员。2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任指数策略研究员兼指数基金经理、基金经理。

注：1. 本基金自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自其作出决定的日期。
2. 证券从业的认定参照中国证监会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、本基金基金合同和基金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，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金运作符合法律法规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。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约定。

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，强化事后监控分析等手段等方式在各业务环节严格控制基金公平执行，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，公平交易机制总体执行情况良好。

异常交易行为的专项说明
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

本基金跟踪标的指数为国证1000指数，中证指数国证1000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(4.0%)×5%。国证1000指数的样本为在深圳、上海证券交易所上市的除金融、43种行业的非金融、流动性较好的前1000家公司。于2005年2月31日生效，用以反映中国股市中大型股票的整体变动趋势。本基金的投资策略：正常情况下，主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金可采用包括但不限于优化复制策略和主动投资管理。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证1000指数A基金份额净值为0.9839元。报告期内，该基金份额净值增长率为28.41%，同期业绩比较基准收益率为28.88%；截至报告期末创金合信国证1000指数C基金份额净值为0.9817元。报告期内，该基金份额净值增长率为28.34%，同期业绩比较基准收益率为28.88%。

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

报告期末基金资产组合情况
序号：1 权益类投资 9,745,951.12 94.22
其中：股票 9,745,951.12 94.22
2 固定收益投资 333,660.00 3.25
其中：债券 333,660.00 3.25
3 贵金属投资 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 256,786.88 2.49
7 其他资产 2,079.71 0.02
8 合计 10,343,677.71 100.00

报告期末按投资行业分类的股票投资组合

报告期末按投资行业分类的股票投资组合
序号：A 农、林、牧、渔业 113,700.00 1.11
B 采矿业 290,870.00 2.83
C 制造业 4,416,899.02 42.98
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 304,924.00 2.97
E 建筑业 266,656.60 2.59
F 批发和零售业 233,484.00 2.27
G 交通运输、仓储和邮政业 288,273.00 2.81
H 信息传输业 - -
I 住宿和餐饮业 - -
J 金融业 208,236.96 2.02
K 房地产业 435,237.00 4.24
L 租赁和商务服务业 144,592.00 1.41
M 科学研究和技术服务业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 37,322.00 0.36
O 医药制造业、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社公工作 79,630.00 0.77
R 文化、体育和娱乐业 83,696.00 0.81
S 综合 60,011.00 0.58
合计 9,745,951.12 94.84

报告期末按股票投资行业分类的股票投资组合

报告期末按股票投资行业分类的股票投资组合
序号：A 农、林、牧、渔业 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 - -
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 信息传输业 - -
I 住宿和餐饮业 - -
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 医药制造业、修理和其他服务业 - -
P 教育 - -
Q 卫生和社公工作 - -
R 文化、体育和娱乐业 - -
S 综合 - -
合计 - -

注：本基金本报告期末未持有科创板股票。

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

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：1 601318 中国平安 6,000 662,600 6.34
2 600519 贵州茅台 300 256,197 2.49
3 601088 中国银行 9,200 187,164 1.83
4 600651 格力电器 2,700 127,467 1.23
5 600333 美的集团 2,600 126,688 1.23
6 600030 中信证券 4,600 113,988 1.11
7 600858 五粮液 1,100 104,500 1.02
8 600276 恒瑞医药 1,596 104,418.32 1.02
9 601328 交通银行 15,900 99,216 0.97
10 600897 伊利股份 3,600 98,974 0.96

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号：1 国债债券 - -
2 央行票据 - -
3 金融债券 333,660.00 3.25
其中：政策性金融债 333,660.00 3.25
4 企业债券 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 - -
7 可转债(可交换债) - -
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 333,660.00 3.25

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

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
序号：1 108603 国开1804 3,320 333,660 3.25

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码：名称：持仓量(买/卖) 合约价值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
公允价值变动总额合计(元) - - - -
股指期货投资本期收益(元) 0 - - -
股指期货投资本期公允价值变动(元) - - - -

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
代码：名称：持仓量(买/卖) 合约价值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
公允价值变动总额合计(元) - - - -
国债期货投资本期收益(元) - - - -
国债期货投资本期公允价值变动(元) - - - -

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

声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
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。

其他资产构成

其他资产构成
序号：1 存出保证金 1,118.27
2 应收证券清算款 - -
3 应收股利 - -
4 应收利息 5,908.44
5 应收申购款 35.00
6 其他应收款 0
7 其他 0
8 其他 - -
9 合计 7,071.71

报告期末持有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不存在流通受限的情况。

开放式基金份额变动

开放式基金份额变动
项目：报告期初基金份额总额 10,456,278.75; 报告期末基金份额总额 5,509,148.17

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
项目：报告期末持有基金份额总额 10,000,700.07; 报告期末持有基金份额总额 5,000,350.04

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号：交易日期：20190301; 交易金额(元)：30,000,700.07; 交易金额(元)：30,000,700.07

注：本基金报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目：持有份额数量 30,000,700.07; 持有份额占基金总份额比例 95.61%

报告期内申购赎回投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内申购赎回投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
申购日期：20190101-20190331; 申购份额 10,000,700.07; 赎回份额 0

本基金在报告期内，存在本报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能存在以下风险：
1. 大额申购/赎回
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到位，则可能降低基金净值涨幅。
2. 大额赎回风险
(1) 若本基金赎回期限内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险。
(2) 若投资者大额赎回时，本基金可能面临赎回款项支付困难，进而影响本基金资产净值。
(3) 若基金管理人无法及时变现基金资产以支付赎回款项，可能导致基金资产净值波动。
(4) 因基金净值核算计算误差，可能导致投资者利益受损。
(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流动性风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度保护基金份额持有人的合法权益。

影响投资者决策的其他重要信息

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. 《创金合信国证1000指数发起式证券投资基金基金合同》；
2. 《创金合信国证1000指数发起式证券投资基金托管协议》；
3. 《创金合信国证1000指数发起式证券投资基金2019年第1季度报告正文》。

存放地点

深圳市福田区中心区平安路1号投行大厦18楼

查阅方式

www.cifund.com