创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-22

目录全部展开 目录全部收拢
- 重要提示
- 基金产品概况
  - 基金基本情况
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
  - 其他指标
- 管理人报告
  - 基金经理（或基金经理小组）简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 公平交易专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明
  - 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
    - 报告期内基金的投资策略和运作分析
    - 报告期内基金的业绩表现
  - 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
- 投资组合报告
  - 报告期末基金资产组合情况
  - 报告期末指数投资按

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年04月19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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

基金基本情况

项目	数值	
基金简称	创金合信国证A股指数	
场内简称		
基金主代码	005414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017-12-28	
报告期末基金份额总额	12,804,695.35	
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，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。	
业绩比较基准	国证A股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上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。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属2级基金的基金简称	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
下属2级基金的场内简称		
下属2级基金的交易代码	005414	005415
报告期末下属2级基金的份额总额	6,593,993.27	6,210,702.08
下属2级基金的风险收益特征		

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主基金(元)	创金合信国证A股指数A(元) 2019-01-01 - 2019-03-31	创金合信国证A股指数C(元) 2019-01-01 - 2019-03-31
本期已实现收益		-10,251.68	-38,648.7
本期利润		1,611,315.18	1,509,825.98
加权平均基金份额本期利润		0.2254	0.2203
期末基金资产净值		6,313,120.24	5,915,732.16
期末基金份额净值		0.9574	0.9525

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

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	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

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

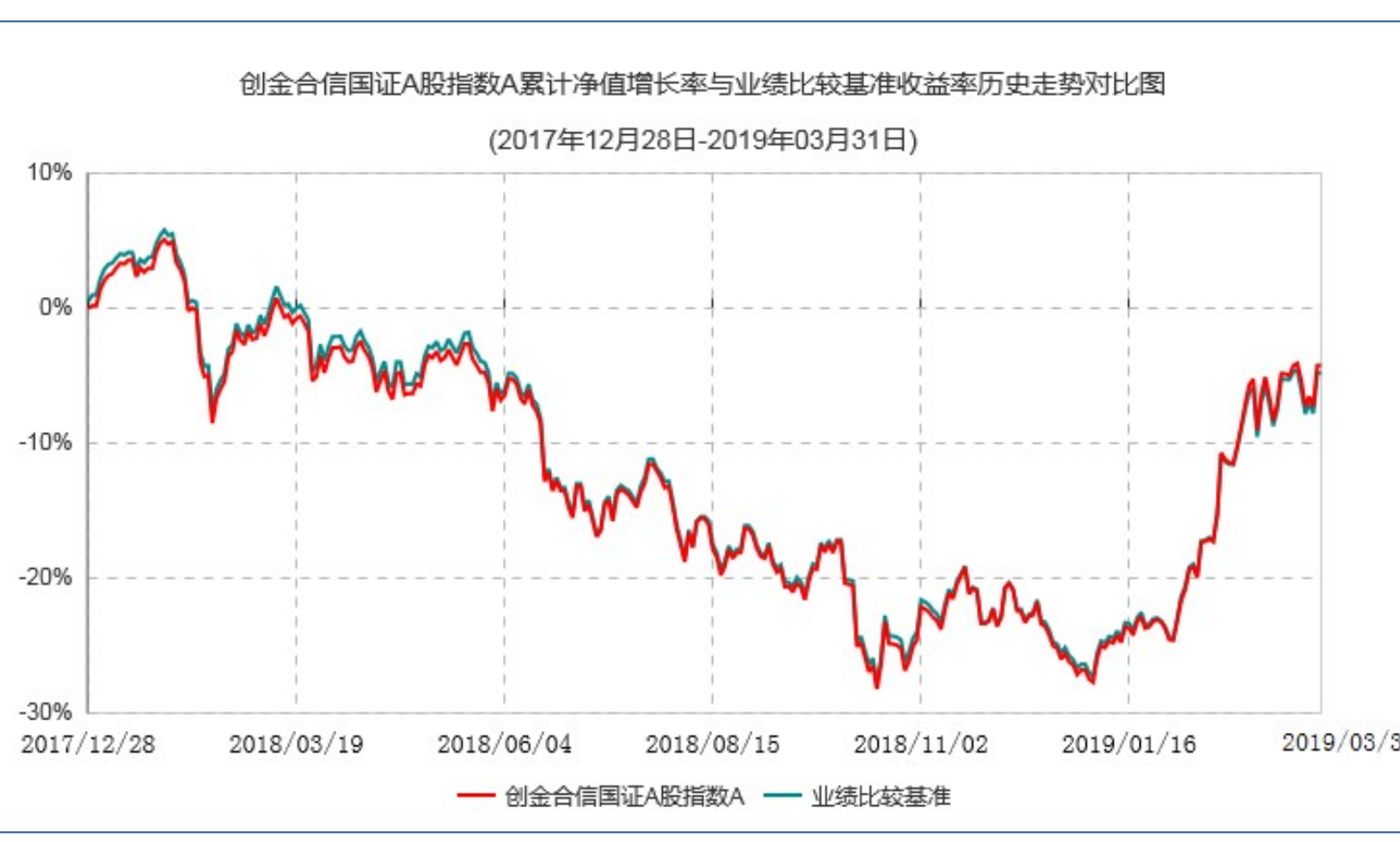
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	30.86 %	1.52 %	29.34 %	1.49 %	1.52 %	0.03 %

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C

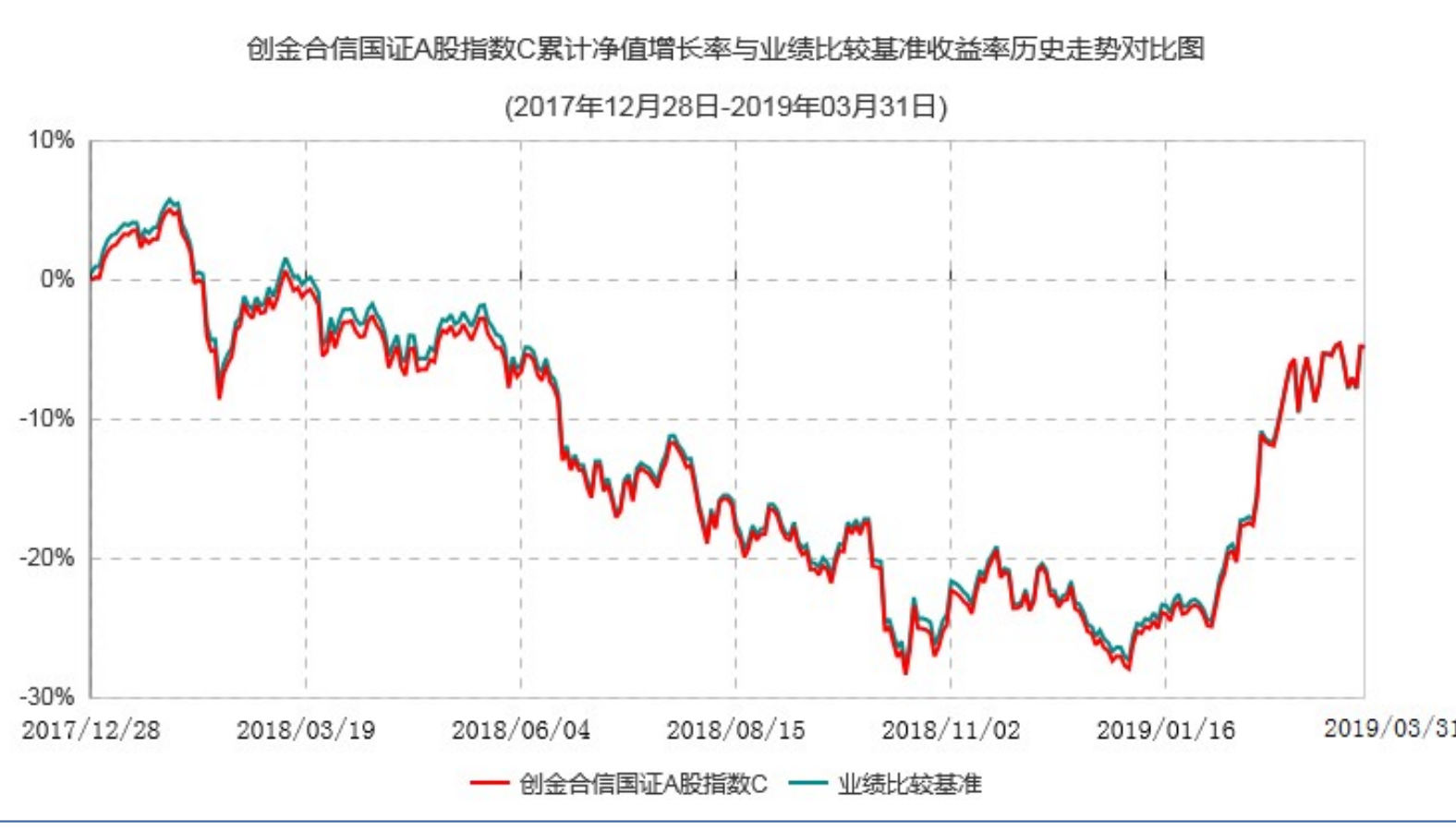
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	30.57 %	1.52 %	29.34 %	1.49 %	1.23 %	0.03 %

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

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A



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C



注：本基金的合同生效日为2018年12月28日，本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

其他指标

单位：人民币元

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

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		
陈龙	本基金基金经理	2017-12-28	-	11年	陈龙先生，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，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任指数策略投资研究部副总监、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。

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。

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。

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

本基金跟踪的标的指数为国证A股指数，业绩基准为国证A股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。国证A股指数的样本股为在深圳、上海证券交易所上市的除ST、*ST股票外的所有A股，于2005年2月3日发布，用以反映中国A股市场股票价格的整体表现。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，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金 将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证A股指数A基金份额净值为0.9574元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.86%，同期业绩比较基准收益率为29.34%；截至报告期末创金合信国证A股指数C基金份额净值为0.9525元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.57%，同期业绩比较基准收益率为29.34%。

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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	11,639,552.86	94.61
	其中：股票	11,639,552.86	94.61
2	固定收益投资	301,500.00	2.45
	其中：债券	301,500.00	2.45
	资产支持证券	-	-
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	353,023.61	2.87
7	其他资产	9,159.71	0.07
8	合计	12,303,236.18	100.00

报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	161,010.00	1.32
B	采矿业	346,715.00	2.84
C	制造业	5,889,064.50	48.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	319,039.00	2.61
E	建筑业	260,293.40	2.13
F	批发和零售业	396,170.00	3.24
G	交通运输、仓储和邮政业	274,102.00	2.24
H	住宿和餐饮业	20,398.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	767,797.60	6.28
J	金融业	2,175,859.20	17.79
K	房地产业	448,347.00	3.67
L	租赁和商务服务业	183,536.60	1.50
M	科学研究和技术服务业	47,569.76	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	39,154.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,000.00	0.16
Q	卫生和社会工作	92,194.20	0.75
R	文化、体育和娱乐业	128,341.60	1.05
S	综合	70,961.00	0.58
	合计	11,639,552.86	95.18

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
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	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	-	-

注： 本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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	601318	中国平安	5,300	408,630	3.34
2	600519	贵州茅台	200	170,798	1.40
3	601166	兴业银行	8,200	148,994	1.22
4	000333	美的集团	2,500	121,825	1.00
5	000651	格力电器	2,500	118,025	0.97
6	600030	中信证券	4,400	109,032	0.89
7	600276	恒瑞医药	1,560	102,055.2	0.83
8	000858	五 粮 液	1,000	95,000	0.78
9	600887	伊利股份	3,200	93,152	0.76
10	300498	温氏股份	2,200	89,320	0.73

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	301,500.00	2.47
	其中：政策性金融债	301,500.00	2.47
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	301,500.00	2.47

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	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（%）
1	108603	国开1804	3,000	301,500	2.47

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

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名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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
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：本基金本报告期末投资国债期货。

本期国债期货投资评价

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

2018年7月13日，宜宾五粮液股份有限公司（下称"五粮液"，股票代码：000858）从四川省纪委、监察委网站获悉宜宾市国有资产经营有限公司董事长张辉（其现任五粮液第五届董事会董事）正接受纪律审查和监察调查。张辉系宜宾市国资公司委派兼任五粮液董事。另2018年8月24日，五粮液从四川省纪委、监察委网站获悉五粮液监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法，目前正接受纪律审查和监察调查。余铭书于2012年7月从宜宾市国有资产经营有限公司调入本公司任职。

本基金投研人员分析认为，上述事项不对五粮液生产经营和长远发展产生影响，五粮液将关注后续进展情况，并按有关规定及时履行相关程序和信息披露义务。五粮液作为白酒行业龙头之一，业绩稳健，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五粮液进行了投资。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,582.44
2	应收证券清算款	0
3	应收股利	-
4	应收利息	5,390.99
5	应收申购款	2,186.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,159.71

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：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信国证A股指数	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
报告期期初基金份额总额		7,050,255.76	7,447,788.77
报告期期间基金总申购份额		2,125,677.08	713,674.90
减：报告期期间基金总赎回份额		2,581,939.57	1,950,761.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）		0	0
报告期期末基金份额总额	12,804,695.35	6,593,993.27	6,210,702.08

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	创金合信国证A股指数	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,400.14	5,000,700.14	5,000,700
报告期期间买入/申购总份额	0	0	0
报告期期间卖出/赎回总份额	0	0	0
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,400.14	5,000,700.14	5,000,700
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	78.11	75.84	80.52

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计					

注：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。

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	10,001,400.14	78.11 %	10,001,400.14	78.11 %	36月
基金管理人高级管理人员	0	0 %	0	0 %	
基金经理等人员	0	0 %	0	0 %	
基金管理人股东	0	0 %	0	0 %	
其他	0	0 %	0	0 %	
合计	10,001,400.14	78.11 %	10,001,400.14	78.11 %	36月

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	20190101 - 20190331	10,001,400.14	0	0	10,001,400.14	78.11 %
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

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、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》；
2、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金托管协议》；
3、创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2019年第1季度报告原文。

存放地点

深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

查阅方式

www.cjhxfund.com