

创金合信睿丰纯债债券型证券投资基金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

重要提示

基金管理人承诺... 基金管理人承诺... 基金管理人承诺...

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金名称 (Fund Name), 场内简称 (Listed Name), etc.

主要财务指标

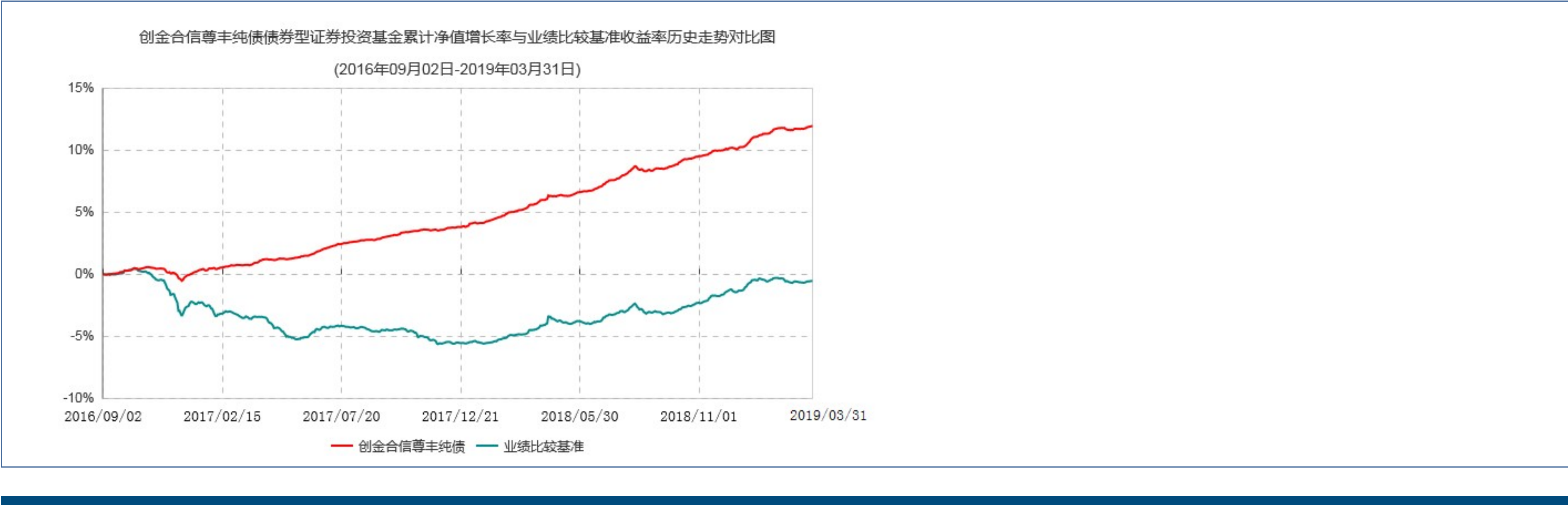
Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (Reporting Period), 本期已实现收益 (Realized Income), etc.

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...

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差 (Standard Deviation), etc.

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

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (Reporting Period).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理时间 (Tenure), etc.

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、本基金会合同和其他有关法律法规的规定...

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、强化事后监控及分析手段等各种方式在各环节严格控制交易公平执行...

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年一季度债券市场呈现总体震荡行情，短端利率下行较多，1年AA信用债收益率下行40-50bp，长端利率基本持平，期限利差有所扩大，信用利差维持压缩，短端表现好于长端，原因在于经济总体呈现下行压力，宽信用推进的环境下，货币政策维持宽松状态，短期利率水平维持在低位水平...

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信睿丰纯债基金份额净值为1.0358元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.42%，同期业绩比较基准收益率为0.47%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

Table with columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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

Table with columns: 序号 (No.), 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), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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

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

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

本基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对股指期货投资进行动态调整，本基金投资股指期货的目的是为了分散投资组合的风险，提高投资效率...

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

本基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对国债期货投资进行动态调整，本基金投资国债期货的目的是为了分散投资组合的风险，提高投资效率...

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

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

本基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对国债期货投资进行动态调整，本基金投资国债期货的目的是为了分散投资组合的风险，提高投资效率...

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况

本报告期内，未发现本基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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，未发现本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

Table with columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount).

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：本基金本报告期末未持有股票。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (份) (Quantity).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (份) (Fund Shares), 基金余额 (元) (Fund Balance).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Fund Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), etc.

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

Table with columns: 投资者类别 (Investor Type), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), etc.

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比例达到或超过20%的情形，可能存在以下风险：

- 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总份额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理的资产管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量出售流动性较差的资产以应对赎回，可能导致基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值波动较大，可能导致赎回费用计入基金资产，导致基金净值有较大波动； (5) 大额赎回时投资者基金份额较小，不能满足赎回条件，可能导致基金全部终止、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，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

影响投资决策的其他重要信息

本报告期内，未发生影响投资决策的其他重要信息。

备查文件目录

- 1. 《创金合信睿丰纯债债券型证券投资基金合同》； 2. 《创金合信睿丰纯债债券型证券投资基金托管协议》； 3. 创金合信睿丰纯债债券型证券投资基金2019年第一季度报告原文。

存放地点

深圳市南山区华侨城一路115号投行大厦16楼

查阅方式

www.cifund.com