

- 重要提示
- 基金管理人及基金托管人保证本报告所披露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。
- 基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年04月22日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
- 本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。
- 本基金过往业绩并不代表其未来表现，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。
- 本报告中财务数据未经审计。
- 本报告自2019年04月10日起至2019年05月31日止。
- 基金净值表现
- 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
- 基金合同生效以来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
- 管理人报告
- 基金管理人及基金经理介绍
- 管理人报告期内本基金投资策略和运作分析
- 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运作分析
- 报告期内基金的投资策略和运作分析
- 报告期内基金的投资策略和运作分析
- 投资组合报告
- 报告期末基金资产组合情况
- 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 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
- 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
- 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
- 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
- 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
- 本期国债期货投资政策
- 投资组合报告附注
- 受处罚及处罚情况
- 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
- 其他资产构成
- 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
- 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 开放式基金份额变动
- 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
- 基金管理人持有基金份额变动情况
- 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
- 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
- 影响投资者决策的其他重要信息
- 备查文件目录
- 存放地点
- 查询方式

重要提示

基金管理人及基金托管人保证本报告所披露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。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年04月22日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本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。本基金过往业绩并不代表其未来表现，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。本报告中财务数据未经审计。本报告自2019年04月10日起至2019年05月31日止。

项目	数值
基金简称	创金合信尊泰纯债债券
场内简称	-
基金主代码	002289
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-10-21
报告期末基金份额总额	320,956.71
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。
投资策略	本基金通过宏观经济形势的跟踪判断，基于对利率、信用市场的分析和预测，综合运用资产配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为纯债型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

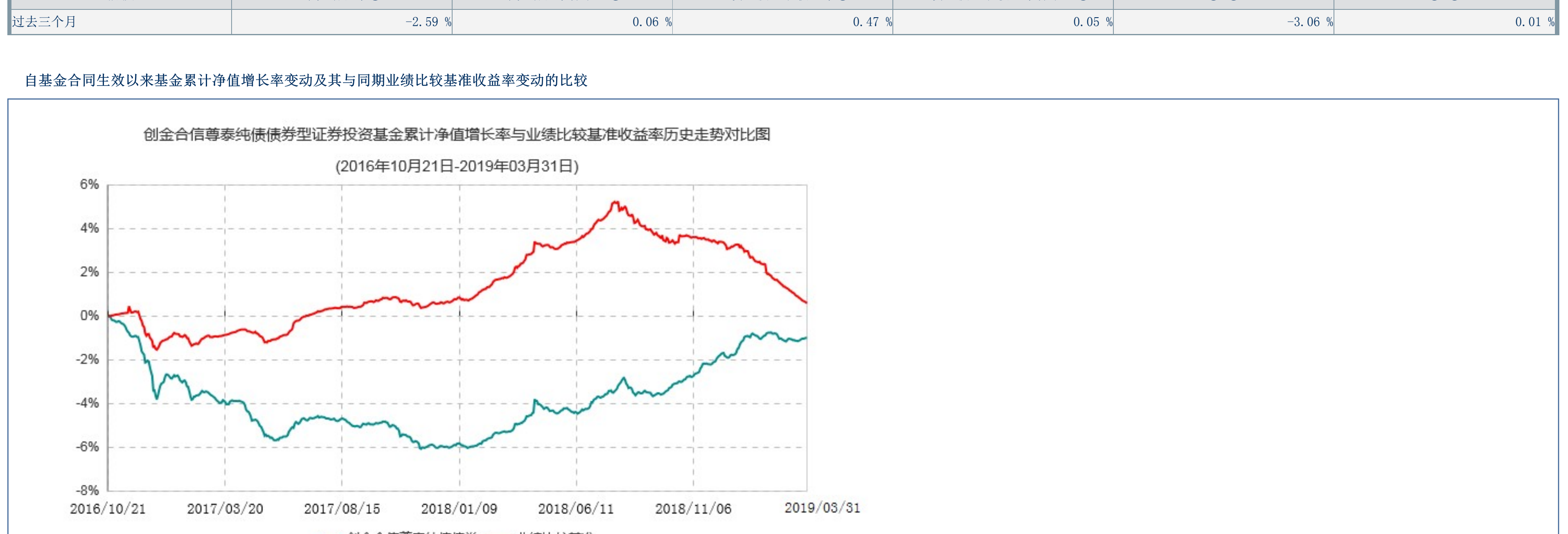
主要财务指标

主要财务指标	报告期(2019-01-01至2019-03-31)
本期已实现收益	-7,039.27
本期利润	-8,329.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0259
期末基金资产净值	312,190.76
期末基金份额净值	0.9727

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

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	-2.59%	0.06%	0.47%	0.05%	-3.06%	0.01%



其他指标

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		
郑振源	本基金基金经理	2016-10-21	-	9年	郑振源先生，中国国籍，中国人民大学研究生部经济学硕士，2009年7月加入第一创业证券研究所，担任宏观策略研究员，2012年7月加入第一创业证券资产管理部，先后担任宏观策略研究员、投资主办等职务，2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。

注：1. 本基金基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期，以本基金基金经理的聘任日期和公司作出的决定日期为准；
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

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，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金运作整体符合合规，未发现损害基金持有人利益的行为；基金的投资范围、投资比例和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

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上行行情，短端利率下行较多，4年AAM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，信用利差继续压缩。短端利率好于长期，原因在于经济总体呈现下行压力、宽信用需求推动下，货币政策维持宽松状态，短期利率水平维持在低位水平；同时，资金成本的降低，杠杆套利策略较为盛行，加大了对短端信用债的需求，从而压缩了信用利差。对于长端利率而言，外部中美贸易摩擦的缓和、内部通胀短期改善，以及央行快速上调等构成短期利好，而经济仍存在的下行压力、债市利率总体震荡上行，再外部边缘通胀改善将加大市场波动。经济下行压力、宽信用需求和货币政策维稳，构成债市的总体有利环境。在宽信用实质见效、经济企稳之前，债市整体风险较小。不过在当前总体利率水平较低的环境下，受短期因素影响波动加大，包括外部贸易关系、内部宽信用推进，乃至房贷上涨等。从策略上来看，组合久期维持适中、宽信用向宽信用的继续转化，将整体影响用基本面；当前政策层对实体经济的优先度资金配置支持较大，市场偏债向未显著改善，投资价值突出；城投融资风险依然可控，“资管新规”与“债务重组”，以及多领域对城投融资的利好政策，为各方基金公募配置提供信用进一步提升，尤其是公益类城投债，而产业类城投债需保持谨慎；对于高收益的企业、融资租赁等行业，信用风险依然较高，需谨慎看待。本基金将继续秉承稳健的投资思路，合理配置资产品种和仓位，努力为投资者获取稳健优异的投资回报。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信尊泰纯债债券基金份额净值0.9727元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.59%，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

截至本报告披露披露日，本基金已连续90个工作日基金份额持有人不满二百人且资产净值低于五千万，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并寻求解决方案。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	300,030.00	79.32
	其中：债券	300,030.00	79.32
	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	67,019.69	17.72
7	其他资产	11,212.88	2.97
8	合计	378,262.57	100.00

报告期末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	-	-
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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

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

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	300,030.00	96.10
	其中：政策性金融债	300,030.00	96.10
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	300,030.00	96.10

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	019005	国开1701	3,000	300,030	96.10

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(克)	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

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

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：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

投资组合报告附注

受处罚及处罚情况

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	0
2	应收证券清算款	0
3	应收股利	0
4	应收利息	11,212.88
5	应收申购款	0
6	其他应收款	0
7	预付费用	-
8	其他	-
9	合计	11,212.88

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

项目	数值
报告期末基金份额总额	321,805.53
报告期间基金总申购份额	0
减：报告期间基金总赎回份额	888.84
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	0
报告期末基金份额总额	320,956.71

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有基金份额变动情况

项目	基金份额
报告期初基金管理人持有的基金份额	292,581.77
报告期间买入/卖出基金份额	0
报告期间期末:基金总份额	0
报告期末基金管理人持有的基金份额	292,581.77
报告期末未持有的基金份额占基金总份额比例(%)	91.16

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
基金管理人自有资金	-	%	-	%	-
基金管理人高级管理人员	-	%	-	%	-
基金管理人人员	-	%	-	%	-
基金管理人股东	-	%	-	%	-
其他	-	%	-	%	-
合计	-	%	-	%	-

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	序号	报告期内持有基金份额变化区间	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间			报告期末持有基金份额	份额占比
			期初份额	中期份额	赎回份额		
机构	1	20190101 - 20190331	292,581.77	0	0	292,581.77	91.16%
个人			-	-	-	-	-

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，若本基金所投资的资产未及及时准备，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20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将对基金资产人的管理造成影响；
(3) 若基金管理人难以及时变现基金投资组合以赎回资金，可能导致基金资产净值出现不利波动，影响基金的投资回报；
(4) 因基金净值波动计算问题，可能导致材料错付入基金资产，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，不能满足赎回条件，可能导致基金无法正常清算等风险。
本基金管理人将建立完善的风险管理机制，可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

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

- 《创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金合同》；
- 《创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 创金合信尊泰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

深圳市福田区中心区深南一路115号投行大厦18楼

查询方式

www.cifund.com