

创金合信尊盛纯债债券型证券投资基金2019年第一季度报告

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

基金管理人及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责任。

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。

基金的投资业绩并不代表其未来业绩表现，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。

本报告自2019年04月01日起至2019年03月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Name), 基金代码 (Fund Code), etc.

主要财务指标

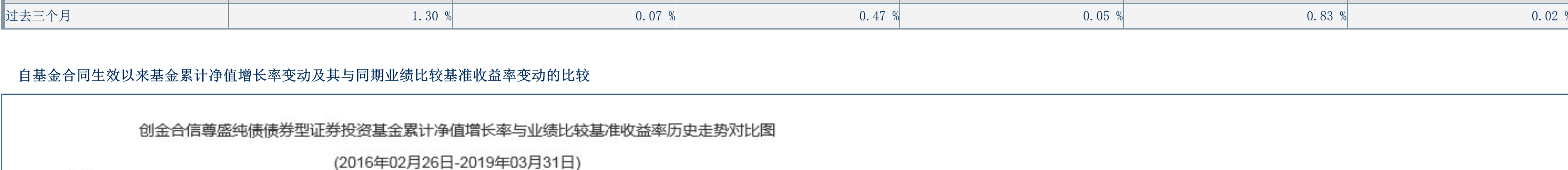
Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

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，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净值增长率① (Net Value Growth Rate). Includes 过去三个月, 过去十二个月, 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 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-01至2019-03-31).

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期限 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Experience), 说明 (Remarks).

注：1. 本基金首任基金经理的任期日期为基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任期日期由基金管理人作出决定的日期。

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、本基金会合同和其他有关法律法规的规定。

公平交易专项说明

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业务环节严格控制交易公平执行。

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低通胀预期，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，信用利差继续压缩，短债表现好于长债，原因在于经济总体呈现下行压力，宽信用需求持续，货币政策保持宽松，短端利率水平维持在低位水平；同时，资金成本的降低，杠杆息差策略较为盛行，加大了对短端利率的需求，从而压缩期限利差。

报告期内基金的投资表现
截至报告期末创金合信尊盛纯债债券基金份额净值为1.016元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.30%，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
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

Table showing portfolio composition: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in RMB), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets).

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(%)

Table showing industry classification of stock investments: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in RMB), 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(%)

Table showing top 10 stocks by fair value: 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 in RMB), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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(%)

Table showing bond portfolio composition: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in RMB), 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(%)

Table showing top 5 bonds by fair value: 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 in RMB), 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
注：本基金本报告期末未有资产支持证券投资。

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(%)

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

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
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

本期国债期货投资评价
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
序号 名称 金额(元)

Table showing other assets: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in RMB).

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有股票。

开放式基金份额变动
项目 数量

Table showing open-ended fund share changes: 项目 (Item), 数量 (Quantity).

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基金份额
报告期末基金管理人持有的基金份额

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

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

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
报告期末持有基金情况

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。

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. 《创金合信尊盛纯债债券型证券投资基金合同》；
2. 《创金合信尊盛纯债债券型证券投资基金托管协议》；
3. 创金合信尊盛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