

创金合信新能源汽车主题股票型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：中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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。
基金合同生效以来基金投资业绩未表现良好，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 columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金名称 (创金合信新能源汽车股票), 场内简称 (创金汽车), 基金代码 (009927), 基金运作方式 (契约封闭式), 基金合同生效日 (2018-05-08), 报告期末基金份额总额 (13,077,820.37), 投资目标 (本基金主要投资新能源汽车主题股票...), 投资策略 (本基金在自上而下的资产配置思路...), 业绩比较基准 (中证新能源汽车产业指数收益率*90%+人民币活期存款利率(税后)*10%), 基金管理人 (创金合信基金管理有限公司), 基金托管人 (中国建设银行股份有限公司), 下属证券投资基金名称 (创金合信新能源汽车股票A, C), 下属证券投资基金的交易代码 (009927), 报告期末下属证券投资基金的总额 (7,361,422.09), 报告期末下属证券投资基金的风险收益特征 (本基金为股票型基金...)

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 本基金(元), 创金合信新能源汽车股票A(元), 创金合信新能源汽车股票C(元). Includes 本期已实现收益 (696,426.07), 本期利润 (848,613.06), 加权平均基金份额本期利润 (0.2114), 期末基金资产净值 (7,506,918.97), 期末基金份额净值 (1.0282).

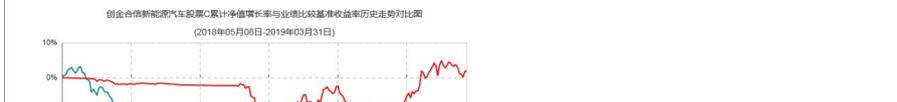
注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table with columns: 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. Includes 本报告期 (13.64%, 1.27%, 18.40%, 1.61%, -4.76%, -0.34%) and 过去三个月 (13.42%, 1.27%, 18.40%, 1.61%, -4.98%, -0.34%).

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
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
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
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



注：1. 本基金的基金合同于2018年5月8日生效，截至本报告期末，本基金成立未满一年。
2. 本基金的建仓期为6个月，建仓期间未对各项资产配置比例符合合同约定。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期末 (2019-01-01至2019-03-31), 本报告期 (2019-03-31).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Includes 曹春林 (基金经理, 2018-05-08, 14年).

注：1. 本基金基金经理的任职日期为基金合同生效日，离任日期，后任基金经理的任职日期由公司董事会作出决定的日期。
2. 证券从业年限的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对本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销售管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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。本报告期内，基金运作整体合法合规，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)，通过建立健全有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控和分析手段等各种方式在各业务环节严格落实控制交易公平执行，公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期内，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

2019年一季度在供给侧改革取得较好进展的情况下市场快速反弹，但是新能源汽车受政策利空压制没有好的表现，传统汽车行业依然处于下滑状态，本年一季度重点投资于节能环保的蓝筹股和电网环节的龙头企业。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信新能源汽车股票A基金份额净值为1.0285元，本报告期内，该基金份额净值增长率为13.44%，同期业绩比较基准收益率为18.40%，截至报告期末创金合信新能源汽车股票C基金份额净值为1.0191元，本报告期内，该基金份额净值增长率为13.42%，同期业绩比较基准收益率为18.40%。

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

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) . Includes 权益类投资 (11,106,658.00, 88.14%), 固定收益投资 (400,040.00, 2.91%), 资产支持证券 (400,040.00, 2.91%), 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (2,094,786.71, 14.57%), 其他资产 (243,516.27, 1.77%), 合计 (12,545,000.98, 100.00%).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%) . Includes 农林牧渔, 医药, 有色金属, 石油、电力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息技术、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 商贸和零售服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计 (11,106,658.00, 83.00%).

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, 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(%) . Includes 000660 (福耀玻璃), 600104 (上汽集团), 601288 (农业银行), 300750 (宁德时代), 300077 (浙富控股), 600066 (宇通客车), 601288 (工商银行), 602632 (国脉光学), 600741 (华域汽车), 600166 (青岛啤酒).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%) . Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券 (400,040.00, 2.99%), 其他金融债券 (400,040.00, 2.99%), 中期票据, 可转债(可交换债), 其他, 合计 (400,040.00, 2.99%).

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, 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(%) . Includes 011805 (国开1701), 4,000, 400,040, 2.99%.

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有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with columns: 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. Includes 公允价值变动总额合计(元), 股指期货投资本期收益(元), 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

Table with columns: 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. Includes 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
本报告期内，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。

申明基金投资的前十名股票是否存在流通受限情况的说明
本报告期内，未出现基金投资的前十名股票存在基金合同约定的流通受限的情况。

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Includes 存出保证金 (13,828.18), 应收证券清算款 (127,247.68), 应收股利, 应收利息 (15,415.02), 应收申购款 (87,315.99), 其他应收款 (0), 其他 (0), 合计 (243,816.27).

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：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 创金合信新能源汽车股票, 创金合信新能源汽车股票A, 创金合信新能源汽车股票C. Includes 报告期期初基金份额总额 (6,263,521.49), 报告期期间基金总申购份额 (1,448,478.79), 减：报告期期间基金总赎回份额 (969,581.27), 报告期期间基金净申购份额 (669,426.07), 报告期末基金份额总额 (13,077,820.37).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目, 创金合信新能源汽车股票, 创金合信新能源汽车股票A, 创金合信新能源汽车股票C. Includes 报告期末持有基金份额 (10,000,400.04), 报告期末持有基金份额占基金总份额比例 (76.47%).

报告期末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, 交易方式, 交易日期, 交易份额(份), 交易金额(元), 适用费率. Includes 合计 (10,000,400.04, 76.47%, 10,000,400.04, 76.47%, 267).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 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. Includes 基金管理人自有资金 (10,000,400.04, 76.47%), 基金管理人高级管理人员 (0, 0%), 基金基金经理人员 (0, 0%), 基金管理人股东 (0, 0%), 其他 (0, 0%), 合计 (10,000,400.04, 76.47%).

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, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Includes 机构 (1, 2019/01/01 - 2019/03/31, 10,000,400.04, 0, 0, 10,000,400.04, 76.47%).

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、大额申购赎回
本基金在发生大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及准备，则可能降低基金净值涨幅。
2、大额赎回风险
(1) 若本基金在短期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，可能会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，影响基金的运作；
(4) 因基金净值核算计算问题，可能因赎回导致基金资产，导致基金净值有较大波动；
(5) 大额赎回导致基金资产流动性紧张，不能满足后续需求，可能导致基金合同终止、清算等风险。
基金管理人将建立完善的赎回限制机制，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

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、《创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金合同》；
2、《创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
3、《创金合信新能源汽车主题股票型发起式证券投资基金2019年第1季度报告原文》。

存放地点

深圳市福田区福华一路119号投行大厦10楼

查阅方式

www.cifund.com