

创金合信春采回报一年定期开放混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者本金增值。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，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 fields like 基金名称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属基金的基金简称, 下属基金的场内简称, 下属基金的交易代码, 报告期末下属基金的资产总额, 下属基金的风险收益特征.

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标, 主基金(元), 创金合信春采回报一年定期混合A(元), 创金合信春采回报一年定期混合C(元). Includes 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

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

Table with 6 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.

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

Table with 6 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.

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

Table with 6 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.

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：1. 本基金的基金合同于2018年07月11日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。
2. 本基金的建仓期为6个月，建仓期结束前各项资产配置比例符合合同约定。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标, 报告期末(2019-01-01至2019-03-31), 报告期末(2019-03-31).

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明. Includes 程志田.

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，以新任基金经理的任职日期由公司董事会作出的决议日期。
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》、《证券投资基金信息披露管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及各项监管规定，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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同约定的规定。

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等手段等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待管理下的所有投资组合，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

回顾2019年一季度，本基金对权益类资产和风险资产采用动态配置策略，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。其中风险资产的投资策略上主要为量化选股策略，同时严格进行风险管理。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信春采回报一年定期混合A基金份额净值为0.9966元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.60%，同期业绩比较基准收益率为6.09%。截至报告期末创金合信春采回报一年定期混合C基金份额净值为0.9969元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为30.62%，同期业绩比较基准收益率为6.09%。

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用此项说明。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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 5 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(%)

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 4 columns: 序号, 债券品种, 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债券。

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债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 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(%)

注：本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 序号, 证券代码, 证券名称, 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 5 columns: 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 5 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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金股指期货投资的投资政策

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 5 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

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人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超出基金合同规定的备选股票范围
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范围的情况。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 应收申购款, 其他应收款, 待摊费用, 其他, 合计.

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 4 columns: 项目, 创金合信春采回报一年定期混合, 创金合信春采回报一年定期混合A, 创金合信春采回报一年定期混合C. Includes 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额净变动, 减: 报告期间基金份额赎回份额, 报告期间基金份额申购份额, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 4 columns: 项目, 创金合信春采回报一年定期混合, 创金合信春采回报一年定期混合A, 创金合信春采回报一年定期混合C. Includes 报告期初管理人持有的基金份额, 报告期间买入/申购的基金份额, 报告期间卖出/赎回的基金份额, 报告期末管理人持有的基金份额, 报告期末管理人持有的基金份额占基金份额总额的比例.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 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

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

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金经理等人员, 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

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 报告期内持有基金份额变化情况, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 报告期末持有份额, 报告期末持有份额占比. Includes 机构, 个人.

注：本基金在报告期内不存在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

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. 《创金合信春采回报一年定期开放混合型发起式证券投资基金合同》；
2. 《创金合信春采回报一年定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
3. 创金合信春采回报一年定期开放混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告原文。

存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦12楼

查阅方式

www.cifund.com