

目录表
重要提示
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
投资组合报告
基金管理人及基金经理简介
其他重要事项
备查文件目录

重要提示

基金管理人及董事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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年03月22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。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数据 (Data). Includes 基金简称 (创会合信汇益纯债一年定期债券), 场内简称, 基金代码 (005782), 基金运作方式 (契约定期开放式), 基金合同生效日 (2018-06-26), 报告期末基金份额总额 (600,513,582.46), 投资策略, 业绩比较基准 (中证综合债指数收益率), 风险收益特征 (本基金为债券型基金, 长期来看, 其预期风险和预期收益水平低于股票型基金, 高于货币市场基金), 基金管理人 (创会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), 下属二级基金的基金简称 (创会合信汇益纯债一年定期债券A, 创会合信汇益纯债一年定期债券C), 下属二级基金的场内简称 (005782, 005783), 下属二级基金的场内代码 (000000, 000001), 下属二级基金的风险收益特征 (同本基金).

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标, 主基金(元), 创会合信汇益纯债一年定期债券A(元) (2019-01-01 - 2019-03-31), 创会合信汇益纯债一年定期债券C(元) (2019-01-01 - 2019-03-31). 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可能会低于所列数字。
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)扣除相关费用后的金额,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

其他指标

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

基金治理 (或基金投资小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间 (任期日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 阮海源 (本基金基金经理, 2018-06-26, 9年) and 张俊 (本基金基金经理, 2018-08-27, 9年).

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，指在基金经理的任职(指任期)期间内作出决定的日期；
2. 证券从业年限指自中国证监会发布《证券基金从业人员资格管理办法》以来的从业时间。

管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

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，基金运作整体合规合法，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，强化事后监控和分析等手段方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待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年一季度非债市场整体表现平稳，短债利率下行较多，AAA信用债收益率下行40-50bp，长债利率基本持平，信用利差继续走阔，短债表现好于长债。近期非债市场在低估值水平下，同时，资金成本持续走低，加大了对短债信用债的需求，从而带动短债利率下行。对于长债而言，外部中美贸易摩擦的持续和，内部社融短期改善，以及供给侧改革等构成利好利空，经济仍存在的下行压力，货币政策保持稳健和我国经济增长趋缓等构成利好利空，多空力量此消彼长，从而造成长债利率波动。在信用债市场整体改善情况下，中游优质企业债仍受青睐，违约风险低。
向前看，债市利率总体保持平稳，内外形势总体逐渐改善加大市场波动，经济下行压力，宽信用不易和货币政策保持稳健，构成债市的总体有利环境。在宽信用实现见效，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相对较低的环境下，受短期因素影响非债波动加大，包括外部贸易关系、内部政策调整等，乃至利率上行等。从策略上來看，组合久期保持适中，宽信用和宽信用的继续转化，将整体改善信用基本面。当前政策对实体经济的支持力度，市场偏宽信用未显著改善，投资性价比突出，城投融资环境持续改善，“货币化棚顶”维持“债务存”，以及多地区对城投债务豁免化解的政策考量，多方面显示公债城投债的信用将进一步回升，尤其是公募类城投债，产业类城投债需谨慎；对于资质较差的企业，融资难以得到改善，信用风险依旧较高，需要谨慎选择。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，努力为客户获取稳健优异的投资回报。

报告期内基金的投资表现

截至报告期末创会合信汇益纯债一年定期债券A的基金份额净值为1.0413元，本报告期内，该类基金的净值增长率为2.30%，同期业绩比较基准收益率为1.35%，截至报告期末创会合信汇益纯债一年定期债券C的基金份额净值为1.0394元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.52%，同期业绩比较基准收益率为1.35%。

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 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) . Includes 权益类投资, 固定收益投资, 资产支持证券, 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, 其他资产, 合计.

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 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、渔业, 采矿业, 制造业, 电力、热力、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, 租赁和商务服务业, 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.

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(%) . Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券, 其中：政策性金融债, 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 合计.

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 5 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 1522054, 1522070, 101800223, 142871, 124771.

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

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资策略

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

受到处罚及调查情况

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超出基金合同规定的备选股票库

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库的情况。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). 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, 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受限。

报告期末按公允价值计量的基金资产净值变动情况

Table with 4 columns: 项目, 创会合信汇益纯债一年定期债券, 创会合信汇益纯债一年定期债券A, 创会合信汇益纯债一年定期债券C. Includes 报告期初基金份额总额, 报告期基金份额总额, 减：报告期基金份额总额, 报告期基金份额总额, 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

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 4 columns: 项目, 创会合信汇益纯债一年定期债券, 创会合信汇益纯债一年定期债券A, 创会合信汇益纯债一年定期债券C. Includes 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期买入/申购总份额, 报告期卖出/赎回总份额, 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) .

注：本基金基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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, 交易日期, 交易品种, 交易数量(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

Table with 6 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.

报告期内基金持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的期间, 期初份额, 中期份额, 期末份额, 持有份额, 份额占比.

本基金在报告期内，存在报告期内同一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能存在以下风险：

1、大额申购风险：若发生投资者大额申购时，若本基金所投资的资产未及准备，则可能导致基金净值波动。

2、大额赎回风险：(1) 若本基金在报告期内发生大额赎回，可能导致基金资产流动性紧张，进而影响基金资产的投资运作；(2) 若本基金在报告期内发生大额赎回，可能导致基金资产流动性紧张，进而影响基金资产的投资运作；(3) 若本基金在报告期内发生大额赎回，可能导致基金资产流动性紧张，进而影响基金资产的投资运作；(4) 因基金份额净值计算出现错误，可能导致基金份额持有人利益受损；(5) 若基金份额净值计算出现错误，可能导致基金份额持有人利益受损；(6) 若基金份额净值计算出现错误，可能导致基金份额持有人利益受损。

3、基金管理人建立完善的内部控制机制，以有效防范上述风险，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. 《创会合信汇益纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
2. 《创会合信汇益纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
3. 《创会合信汇益纯债一年定期开放债券型证券投资基金2019年第一季度报告》。

存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦18楼

查阅方式

www.cjhfund.com