

目录
一、重要提示
二、基金基本情况
三、主要财务指标
四、基金净值表现
五、管理人报告
六、公平交易专项说明
七、报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
八、报告期内管理人对于本基金资产净值预警情形的说明
九、投资组合报告
十、其他重要事项
十一、基金管理人承诺
十二、基金托管人承诺
十三、备查文件目录

重要提示

基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。
基金托管人中国工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，也不保证最低收益。
基金的投资业绩并不代表其未来表现，投资者有风险，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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2019年01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). Rows include 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, 报告期末基金总份额, 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.

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). Rows include 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.

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
过去三个月: 净值增长率①: 19.67%, 净值增长率标准差②: 1.16%, 业绩比较基准收益率③: 13.48%, 业绩比较基准收益率标准差④: 0.76%, ①-③: 6.19%, ②-④: 0.40%

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
(2015年08月24日-2019年03月31日)



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). Rows include 基金份额持有人数量, 基金资产净值.

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 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Rows include 陈玉祥, 胡凌波.

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, 后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期;
2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券基金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

本报告期, 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, 本基金运作整体符合法律法规的规定, 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, 公平对待所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

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年一季度市场呈现全面快速回升走势, 上证50、沪深300、中证2000、创业板指等代表性中小市值风格一季度涨幅达到24%-35%, 基金组合一季度保持了低市值、低估值、固收风格配置, 组合弹性与市场平均水平基本一致。未来组合策略上采取大/小市值、高/低估值结合的增持策略, 个股方面坚持“三低”选股策略, 重点关注国家关于国企改革降杠杆政策导向下国企改革个性化基本面反转机会。同时采取类股票的超额收益滚动策略, 适度减仓涨幅大的个股转换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业风格个股的超跌个股, 提升组合弹性和控制回撤风险。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信沪深港深精选混合基金份额净值为1.077元, 本报告期内, 基金份额净值增长率为19.67%, 同期业绩比较基准收益率为13.48%。

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 5 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Rows include 权益类投资, 固定收益投资, 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, 其他资产, 合计.

注: 本基金本报告期末通过沪港深交易机制投资的港股公允价值为2,066,072.99元, 占净值比为0.54%。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 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). Rows include 农林牧渔, 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.

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with 4 columns: 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). Rows include 能源, 金融, 工业, 合计.

注: 1、以上分类采用全球行业分类标准 (GICS);
2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有误差。

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 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 600731, 600089, 600859, 600757, 601333, 600081, 600028, 600125, 600519, 600883.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 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). Rows include 国债, 央行票据, 金融债, 企业债, 可转债, 其他.

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 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

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

注: 本基金本报告期未投资股指期货。

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 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Description).

注: 本基金本报告期未投资国债期货。

本基金投资股指期货的投资政策

注: 本基金本报告期未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注: 本基金本报告期未投资国债期货。

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 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB), 风险说明 (Risk Description).

注: 本基金本报告期未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

注: 本基金本报告期未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

中兵红箭(000519)10月10日晚发布公告称, 10月9日, 公司收到了湖南省政府下发的《行政处罚事先告知书》。因涉嫌信息披露违法, 湖南证监局对公司及相关当事人给予警告并处以3万元到30万元不等罚款。中兵红箭2014-2015年度虚增利润953.7万元、2230.89万元, 2016年度虚增利润556.99万元, 分别占当年年度利润总额的比例为0.2%、8.35%、3.52%。
本基金基金管理人中国工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、误导性陈述或重大遗漏。
本基金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, 也不保证最低收益。
基金的投资业绩并不代表其未来表现, 投资者有风险, 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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

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

注: 本基金本报告期, 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 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB). Rows include 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, 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 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity). Rows include 报告期末基金份额总额, 报告期间基金份额申购份额, 报告期间基金份额赎回份额, 报告期间基金总申购份额, 报告期间基金总赎回份额, 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

注: 本基金基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Rows include 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期间基金管理人申购总份额, 报告期间基金管理人赎回总份额, 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(%)

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Shares), 交易金额 (元) (Amount in RMB), 适用费率 (Applicable Rate).

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 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Issued Shares).

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 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Share Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Initial Shares), 中期份额 (Mid-term Shares), 期末份额 (End-term Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Proportion).

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

注: 本基金在报告期内, 未出现影响投资者决策的其他重要信息。

备查文件目录

- 1、《创金合信沪深港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金合同》;
2、《创金合信沪深港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信沪深港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2019年3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.cifund.com