创金合信量化核心混合型证券投资基金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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-20

基金基本情况
重要提示
§2 财产组合
§3 基金管理人
§4 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明
§5 托管人
§6 报告期内基金投资组合情况
§7 报告期内股票投资组合的重大变动
§8 报告期内按照证券品种分类的期末债券投资组合
§9 报告期内按照公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资组合
§10 报告期内按照公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合
§11 投资组合报告附注
§12 基金管理人认为需要说明的其他信息
§13 开放式基金份额变动
§14 影响投资者决策的其他重要信息
§15 备查文件目录

重要提示

本基金管理人创金合信基金管理有限公司保证按照法律、法规、证券投资基金运作管理办法、基金合同和其他有关规定，诚实信用、勤勉尽责地对待全体基金持有人。

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。

基金管理人提醒投资者注意基金投资的风险，投资有风险，投资者在作出投资决策前应对相关信息进行全面了解，并根据自己的投资目的、投资期限、投资风险承受能力做出独立的投资决策。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期2019年01月01日至2019年03月31日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	创金合信量化核心混合
场内简称	-
基金主代码	004209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-03-27
报告期末基金份额总额	89,139,880.80份
投资目标	在控制风险的前提下，通过量化模型对证券价值的管理，以期为“长期资产”的资产配置策略，形成相对优势产品配置比例及风险控制，进而确定资产配置比例并实现，其中，本基金在股票资产配置比例时以主要考虑宏观因素，政策导向，产业经济，市场情绪，投资者行为等因素。
投资策略	宏观策略决策因素：宏观经济增长情况，通货膨胀水平，利率水平，汇率水平，国际收支状况，财政收入状况，货币政策，政策导向，投资者行为等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数（总值）收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金水平高于债券型基金水平的风险收益水平。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属A类份额简称	创金合信量化核心混合A
下属D类份额简称	创金合信量化核心混合C
下属A类份额交易代码	004209
下属D类份额交易代码	004210
报告期末下属A类份额总份额	57,921,411.92
报告期末下属D类份额总份额	31,218,468.88

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	上期金（元）	创金合信量化核心混合A(C类) 2019-01-02 - 2019-03-31	创金合信量化核心混合C(C类) 2019-01-02 - 2019-03-31
本期已实现收益		-6,161,995.44	-1,997,517.82
本期利润		-13,521,188.95	-6,927,425.36
加权平均基金份额本期利润		-0.2051	-0.1490
期末基金资产净值		85,550,416.28	32,406,222.48
期末基金份额净值		1.4877	1.0752

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，上述费用计入实际基金净值计算或收益率计算。

2、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入扣除公允价值变动损益后的金额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

基金净值表现

本期及最近会计年度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

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
本期及最近会计年度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						
过去一个年度	22.32 %	1.33 %	22.73 %	1.23 %	-0.17 %	0.03 %
本期及最近会计年度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						
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
过去一个年度	22.32 %	1.33 %	22.73 %	1.23 %	-0.17 %	0.03 %
本期及最近会计年度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						
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
过去一个年度	22.32 %	1.33 %	22.73 %	1.23 %	-0.17 %	0.03 %

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

暂无数据

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

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-01至2019-03-31）
其他指标	报告期（2019-01-1）

报告期内基金投资和赎回情况统计

单位：人民币元				
报告期内基金投资和赎回情况统计				
单位：人民币元				