

创金合信金融地产精选股票型证券投资基金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：中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。
基金托管人中国邮政储蓄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。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 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2级基金的名称, 下属2级基金的场内简称, 下属2级基金的交易代码, 报告期末下属2级基金的资产总额, 报告期末下属2级基金的风险收益特征.

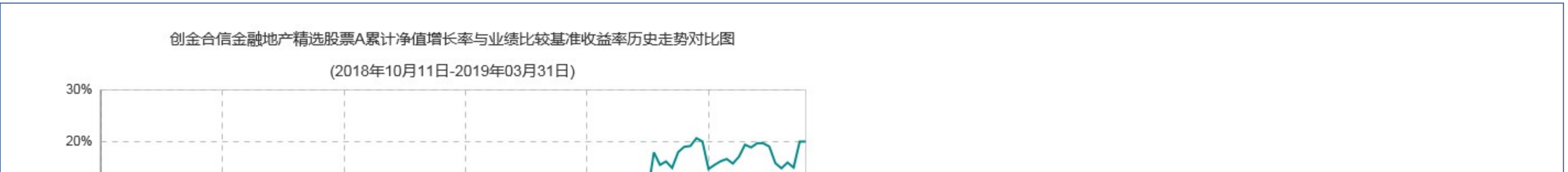
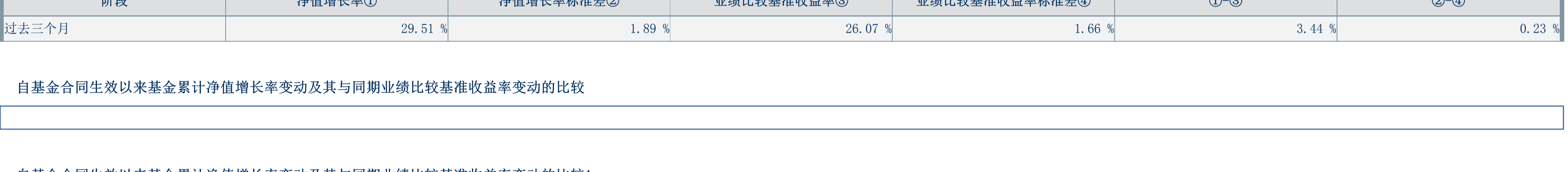
主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 主基金(元), 创金合信金融地产精选股票A(元), 创金合信金融地产精选股票C(元). Includes rows for 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

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 rows for 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较, 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较A, 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较C.



注：1. 本基金的基金合同于2018年10月11日生效，截至本报告期末，本基金成立不满一年。
2. 按照本基金的基金合同约定，自基金合同生效之日起6个月内将基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分二、投资范围、三、投资策略和四、投资限制的有关约定。本报告期末基金处于建仓期内。

其他指标

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

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes entry for 李楠, 本基金基金经理, 2018-10-11, 6年, 李楠女士，中国国籍，上海交通大学硕士，2012年4月加入兴业证券股份有限公司研究所，担任地产行业研究员，主要从事房地产行业跟踪和股票推荐等工作，2015年6月加入创金合信基金管理有限公司，历任研究员助理、基金经理助理，现任基金经理。

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、后任基金经理的任职日期由公司公告作出决定日期；
2. 证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
2018年10月11日创金合信鑫利资产配置混合型证券投资基金转换为创金合信金融地产精选股票型投资基金，基金经理由张英、闫一航变更为李楠。

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、基金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），通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程，交易决策、调仓事后监控及分析后评估等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下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

10月和11月社融数据尚未企稳，M2及增速持续走低，经济下行压力加大，宽基虽显转机，但仍存不确定性。从股上看，四季度数据持续下行，虽受政策影响10月下旬有所反弹，但上证综指全年仍以15年来最低收盘价收场，市场情绪低迷，交投清淡。本基金本季度完成转型，成为金融地产行业基金，整体而言，目前市场经历深度调整，金融地产板块估值处于历史底部区间，在不出现极端危机的前提下，金融板块相对较稳定，具备长期配置价值。本基金将仓位主要配置在券商、地产、银行等板块龙头，并选择配置保险龙头。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信金融地产精选股票A基金份额净值为0.9621元，本报告期内，该基金份额净值增长率为29.69%，同期业绩比较基准收益率为26.07%；截至报告期末创金合信金融地产精选股票C基金份额净值为0.9599元，本报告期内，该基金份额净值增长率为29.33%，同期业绩比较基准收益率为26.07%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末披露日报日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

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 rows for 权益类投资, 其中：股票, 固定收益投资, 其中：债券, 资产支持证券, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其中：买断式回购的买入返售金融资产, 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 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%) . Includes rows for A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 医药制造业, I 信息技术、软件和信息技术服务业, J 金融业, K 房地产业, L 租赁和商务服务业, M 科学研究和技术服务业, N 水利、环境和公共设施管理业, O 居民服务、修理和其他服务业, P 教育, Q 卫生和社会工作, R 文化、体育和娱乐业, S 综合, 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 rows for 招商银行, 中国平安, 东方财富, 长城控股, 万科A, 中信证券, 新华保险, 平安银行, 广发银行, 兴业银行.

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 rows for 国债券, 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 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 row for 开元1701.

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

Table with columns: 代码, 名称, 持仓金额(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明. Includes rows for 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。

本基金股指期货期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内国债期货投资策略

报告期末本基金投资的国债期货持仓和品种明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约面值(元), 公允价值变动(元), 风险指标说明. Includes rows for 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的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、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 columns: 序号, 名称, 金额(元). Includes rows for 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, 创金合信金融地产精选股票, 创金合信金融地产精选股票A, 创金合信金融地产精选股票C. Includes rows for 报告期末基金份额总额, 报告期新增基金份额总额, 报告期赎回基金份额总额, 报告期基金申购份额(含红利再投资), 报告期基金转换转入份额(含红利再投资), 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 columns: 项目, 创金合信金融地产精选股票, 创金合信金融地产精选股票A, 创金合信金融地产精选股票C. Includes rows for 报告期末持有本基金基金份额, 报告期初持有本基金基金份额, 报告期买入/申购总份额, 报告期卖出/赎回总份额, 报告期末持有本基金基金份额, 报告期末持有本基金基金份额占基金总资产比例(%).

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(股), 交易金额(元), 适用费率. Includes row for 合计.

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, 持有份额占基金份额总额比例, 发起资金持有份额, 发起资金持有份额占基金总额比例, 发起资金持有份额占基金总额比例. Includes rows for 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理, 基金管理人其他人员, 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 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 rows for 机构, 个人.

本基金在报告期内，存在报告期末单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，可能存在以下风险：
1. 大额申购/赎回
大额申购或赎回发生时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能导致基金净值波动。
2. 大额赎回风险
（1）若本基金在短期内难以变现持有的资产予以应对，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资产总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，则可能对基金管理人的管理造成影响；
（3）因赎回人数众多造成基金赎回款的以现金形式支付，可能导致基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；
（4）因基金净值核算计算问题，可能导致赎回费用计入基金资产，导致基金净值有较大波动；
（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。
本基金管理人将建立完善的风险管理机制，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. 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金合同；
2. 《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》；
3. 创金合信金融地产精选股票型证券投资基金2019年第1季度报告原文。

存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦18楼

查阅方式

www.cifund.com