

基金管理人 创金合信基金管理有限公司
基金托管人 中国农工银行股份有限公司
报告送出日期 2019-04-22

重要提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并保证基金资产的安全、完整和增值。
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,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并保证基金资产的安全、完整和增值。
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,不从事违法、违规、损害基金份额持有人利益的行为,并保证基金资产的安全、完整和增值。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数据 (Data). Includes details like 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金管理人 (Fund Manager), etc.

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 主基金(元) (Main Fund in Yuan), 创金合信中证1000增强A(元) (CIC 1000 Enhance A in Yuan), 创金合信中证1000增强C(元) (CIC 1000 Enhance C in Yuan).

基金业绩表现

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Std Dev 2), etc.



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 数据 (Data).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date).

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、基金合同和基金法律文件的约定,诚实信用,勤勉尽责,恪守职业道德,严格控制投资风险,维护基金份额持有人的合法权益。

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),通过建立有效、规范的投资研究和决策流程,交易流程,强化事前、事中、事后全流程公平交易监控,严格执行公平交易制度,公平对待所有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
报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,本基金与管理人管理的其他投资组合就同一只股票同日发生的交易行为,本基金与基金管理人管理的其他投资组合就同一只股票同日发生的交易行为,本基金与基金管理人管理的其他投资组合就同一只股票同日发生的交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年一季度,我们继续在底部区域进行投资,并严格执行风险控制。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证1000增强A基金份额净值为0.9939元,本报告期内,该基金份额净值增长率为33.23%,同期业绩比较基准收益率为31.61%;截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为0.9882元,本报告期内,该基金份额净值增长率为32.89%,同期业绩比较基准收益率为31.61%。

报告期内基金持有人户数或基金份额净值预警说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets).

报告期末指数投资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 Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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 (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 Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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), 股票代码 (Stock Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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 Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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), 股票代码 (Stock Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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 4 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货,均以套期保值为目的,本季度进行了少量套期保值操作。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货交易政策

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

本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受到谴责以及处罚情况

2019年7月20日,江西正邦科技股份有限公司(下称正邦科技,股票代码:002157)下属子公司肇庆正邦养殖有限公司收到肇庆市环境保护局出具的《行政处罚决定书》(肇环行〔2018〕0605号)、《行政处罚决定书》(肇环行〔2018〕0607号)及《责令改正违法行为决定书》(肇环改字〔2018〕0607号)。公司下属分公司肇庆正邦养殖有限公司收到肇庆市环境保护局出具的《行政处罚决定书》(肇环行〔2018〕180605号)、《行政处罚决定书》(肇环行〔2018〕0606号)及《责令改正违法行为决定书》(肇环改字〔2018〕0606号)。受罚金额共计2600万元,占正邦科技2017年实现营业收入的0.83%,占2017年度归属于上市公司股东的净利润的3.5%,占2017年度末净资产的0.8%。

申明基金投资的前十名股票是否涉及基金合同约定的备选股票程序
报告期内,未出现基金投资的前十名股票涉及基金合同约定的备选股票的情形。

Table with 2 columns: 其他资产构成 (Other Assets Composition) and 金额(元) (Amount in Yuan).

Table with 2 columns: 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细 (Report End Holders of Convertible Bonds in the Process of Conversion) and 金额(元) (Amount in Yuan).

报告期末前十名投资中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

Table with 4 columns: 项目 (Item), 创金合信中证1000增强A (CIC 1000 Enhance A), 创金合信中证1000增强C (CIC 1000 Enhance C), 创金合信中证1000增强C (CIC 1000 Enhance C).

Table with 4 columns: 项目 (Item), 创金合信中证1000增强A (CIC 1000 Enhance A), 创金合信中证1000增强C (CIC 1000 Enhance C), 创金合信中证1000增强C (CIC 1000 Enhance C).

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易数量(份) (Transaction Quantity), 交易金额(元) (Transaction Amount), 说明 (Remarks).

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情况。

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有基金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).

Table with 5 columns: 投资者类型 (Investor Type), 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 Shareholding Ratio Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 期末持有份额 (End of Period Shares).

本基金报告期内,不存在报告期末前十大投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,可能存在以下风险:
(1) 大额申购或赎回: 本基金在报告期内,若发生大额申购或赎回,可能导致基金资产未及预期,从而降低基金净值涨幅。
(2) 大额赎回风险: 若本基金在报告期内,若发生大额赎回,可能导致基金资产未及预期,从而降低基金净值涨幅。
(3) 基金资产净值波动: 若本基金在报告期内,若发生大额赎回,可能导致基金资产未及预期,从而降低基金净值涨幅。
(4) 基金资产净值波动: 若本基金在报告期内,若发生大额赎回,可能导致基金资产未及预期,从而降低基金净值涨幅。
(5) 大额赎回风险: 若本基金在报告期内,若发生大额赎回,可能导致基金资产未及预期,从而降低基金净值涨幅。

影响投资决策的其他重要信息

报告期内,未出现影响投资决策的其他重要信息。

备查文件目录

- 1、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》;
3、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年第1季度报告》。

存放地点
深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

查阅方式
www.cifund.com