创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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年04月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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、误导性陈述或者重大遗漏。
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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金沪港深精选混合
基金主代码	001662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月24日
报告期末基金份额总额	357,782,669.35份
投资目标	本基金积极进行资产配置,深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资,充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果,在有效控制风险的前提下,力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取灵活的资产配置体系,通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类资产的风险收益特征水平进行综合分析,并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标,灵活动态地调整固定收益类资产和权益类资产的比例,以规避或控制市场系统性风险,从而实现长期稳健增长的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数(全价)收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日 - 2019年03月31日)
1.本期已实现收益	-15,667,010.50
2.本期利润	66,954,531.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.1766
4.期末基金资产净值	385,190,683.07
5.期末基金份额净值	1.077

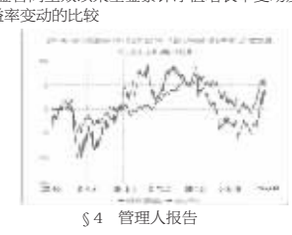
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

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
过去三个月	19.67%	1.16%	13.48%	0.76%	6.19%	0.40%

3.2.2 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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈玉辉	本基金基金经理,投资一部总监	2015-8-24	-	15年	陈玉辉先生,中国国籍,经济学硕士,2003年6月加入新疆证券有限责任公司,从事石化行业研究,2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所,任化工行业研究员。2008年3月加入招商基金管理有限公司,历任研究部副总监、总监,并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年4月加入创金合信基金管理有限公司,现任投资一部总监、基金经理。
胡尧盛	本基金基金经理	2017-12-12	-	5年	胡尧盛先生,中国国籍,江西财经大学金融学硕士,2013年7月加入国元咨询服务(深圳)有限公司,任研究部研究员,负责港股市场消费品行业研究分析工作。2015年6月加入创金合信基金管理有限公司任研究部研究员,现任基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

4.2 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、本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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4 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、创业板指等代表性大中小市值风格一季度涨幅达到24%-35%。基金组合一季度维持了低市净率、低市值、国企股风格配置,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/低贝塔结合的哑铃型策略,个股方面坚持"三低"选股策略,重点关注国家关于国企尽快降杠杆政策导向下国企改革个性化基本面反转机会。同时采取卖涨买跌的超额收益轮动策略,适度减仓涨幅大的个股置换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业或风格的超跌个股,提升组合弹性和控制回撤风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金沪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%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	312,995,301.14	81.01
	其中:股票	312,995,301.14	81.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	53,105,007.64	13.74
8	其他资产	20,271,191.15	5.25
9	合计	386,371,499.93	100.00

注:本基金本报告期末通过沪港通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%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	167,829,291.12	43.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	53,853,701.49	13.98
G	交通运输、仓储和邮政业	28,398,153.92	7.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	0.01
J	金融业	32,517,565.30	8.44
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	28,297,613.38	7.35
S	综合	-	-
	合计	310,929,228.15	80.72

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	739,414.96	0.19
金融	1,116,671.02	0.29
工业	209,986.99	0.05
合计	2,066,072.99	0.54

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的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 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

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(%)
1	600731	湖南海利	6,040,526	34,793,429.76	9.03
2	600089	特变电工	2,968,802	24,581,680.56	6.38
3	600859	王府井	1,288,880	24,295,388.00	6.31
4	600757	长江传媒	2,790,709	20,288,454.43	5.27
5	601333	广深铁路	4,487,032	15,973,833.92	4.15
6	600861	北京城乡	1,788,871	14,650,853.49	3.80
7	600328	兰太实业	1,488,800	13,086,552.00	3.40
8	600125	铁龙物流	1,438,000	12,424,320.00	3.23
9	000519	中兵红箭	1,400,000	12,320,000.00	3.20
10	600893	博闻科技	1,588,856	12,138,859.84	3.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 中兵红箭(000519)10月10日晚间发布公告称,10月9日,公司收到了湖南证监局下发的《行政处罚事先告知书》。因涉嫌信息披露违法,湖南证监局拟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93.7万元、2730.89万元;2016年度虚减利润555.99万元。分别占当年度年报披露利润总额的比例为0.2%、8.95%、3.52%。

本基金基金经理认为中兵红箭所受处罚决定属于常规性会计处理错误,且占当期利润比例不大,且历史报表修正后对未来投资判断没有实质性影响,不影响对投资价值判断。公司相关立案调查事宜已经调查终结,退市风险提示解除。作为军工央企控股的上市公司,投资组合未来将继续持有相关股票并持续跟踪基本面变化。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对中兵红箭进行了投资。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,939.20
2	应收证券清算款	20,136,962.80
3	应收股利	-
4	应收利息	13,043.79
5	应收申购款	72,245.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,271,191.15

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	389,590,510.82
报告期期间基金总申购份额	8,931,369.98
减:报告期期间基金总赎回份额	40,739,211.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	357,782,669.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
2019年04月22日

创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:创金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
报告送出日期:2019年04月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信价值红利混合	
基金主代码	002463	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年04月23日	
报告期末基金份额总额	12,896,936.74份	
投资目标	在控制风险的同时,追求超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采取定量与定性相结合的方法,运用"自上而下"的资产配置逻辑,形成对大类资产预期收益及风险的判断,进而确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的具体比例。 在资产配置中,本基金主要考虑(1)宏观经济指标,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等,以判断经济波动对市场的影响;(2)微观经济指标,包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期;(3)市场方面指标,包括股票及债券市场的流动及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化;(4)政策因素,与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	创金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	
下属分级基金的基金简称	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C
下属分级基金的交易代码	002463	005404
报告期末下属分级基金的份额总额	6,191,197.98份	6,705,738.76份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日 - 2019年03月31日)	
	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C
1.本期已实现收益	1,429,266.28	1,503,079.74
2.本期利润	1,430,225.20	1,767,088.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1600	0.1545
4.期末基金资产净值	6,435,762.06	6,883,325.50
5.期末基金份额净值	1.0395	1.0265

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

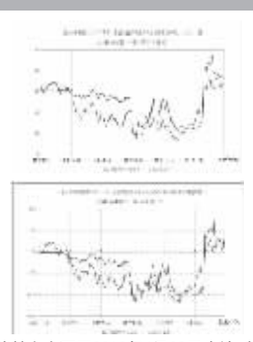
创金合信价值红利混合A净值表现

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
过去三个月	14.07%	1.32%	16.73%	0.93%	-2.66%	0.39%

创金合信价值红利混合C净值表现

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
过去三个月	13.90%	1.32%	16.73%	0.93%	-2.83%	0.39%

3.2.2 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



注:1、本基金的基金合同于2018年4月23日生效,截至报告期末,本基金成立不满一年。
2、本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈玉辉	本基金基金经理,投资一部总监	2018-4-23	-	15年	陈玉辉先生,中国国籍,经济学硕士,2003年6月加入新疆证券有限责任公司,从事石化行业研究,2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所,任化工行业研究员。2008年3月加入招商基金管理有限公司,历任研究部副总监、总监,并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年4月加入创金合信基金管理有限公司,现任投资一部总监、基金经理。
曹春林	本基金基金经理	2018-9-7	-	14年	曹春林先生,中国国籍,厦门大学学士,1998年7月就职于中国银河证券,从事研究工作。2004年3月就职于茂业集团,从事资本运作、证券投资工作。2010年4月加盟第一创业证券股份有限公司,历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。2014年8月加入创金合基金管理有限公司,曾任投资经理兼副总监兼投资经理,现任基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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、本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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度在社融等宏观数据有好转的情况下市场快速反弹,本产品聚焦于业绩增长比较确定的龙头企业。一季度重点投资大金融、5G等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信价值红利混合A基金份额净值为1.0395元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为14.07%,同期业绩比较基准收益率为16.73%;截至报告期末创金合信价值红利混合C基金份额净值为1.0265元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为13.90%,同期业绩比较基准收益率为16.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本财务报告批准报出日,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,336,446.16	31.53
	其中:股票	4,336,446.16	31.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,800,680.00	49.44
	其中:债券	6,800,680.00	49.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,695,593.92	12.33
8	其他资产	921,905.94	6.70
9	合计	13,754,626.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	935,300.00	7.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	446.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,400,700.00	25.53
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	4,336,446.16	32.56

5.3 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

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(%)
1	601398	工商银行	210,000	1,169,700.00	8.78
2	601288	农业银行	300,000	1,119,000.00	8.40
3	601939	建设银行	160,000	1,112,000.00	8.35
4	300750	宁德时代	5,000	425,000.00	3.19
5	000063	中兴通讯	7,000	204,400.00	1.53
6	002050	三花智控	10,000	156,700.00	1.18
7	600884	杉杉股份	10,000	149,200.00	1.12
8	600858	银座股份	78	446.16	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,800,680.00	51.06
	其中:政策性金融债	6,800,680.00	51.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,800,680.00	51.06

5.5 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

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(%)
1	018005	国开1701	68,000	6,800,680.00	51.06

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	59,747.98
2	应收证券清算款	509,454.75
3	应收股利	-
4	应收利息	254,121.05
5	应收申购款	98,582.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	921,905.94

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C
报告期期初基金份额总额	8,866,709.87	14,452,387.43
报告期期间基金总申购份额	3,341,663.22	2,178,630.48
减:报告期期间基金总赎回份额	6,017,175.11	9,925,279.15
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	6,191,197.98	6,705,738.76

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
2019年04月22日

创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

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年04月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信金融地产精选股票
基金主代码	003232
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年10月11日
报告期末基金份额总额	10,247,534.40份
投资目标	本基金通过对金融地产行业进行研究和分析,精选行业内具有核心竞争优势和持续成长潜力的上市公司,力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置思路,根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪,综合运用定性和定量的方法,对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估,确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。
业绩比较基准	中证金融地产指数收益率*90%+人民币活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的交易代码	003232	003233
报告期末下属分级基金的份额总额	6,371,007.70份	3,876,526.70份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日 - 2019年03月31日)	
	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
1.本期已实现收益	405,769.93	241,469.46
2.本期利润	1,228,234.54	760,733.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2143	0.2185
4.期末基金资产净值	6,131,747.55	3,721,222.71
5.期末基金份额净值	0.9624	0.9599

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

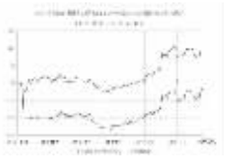
创金合信金融地产精选股票A净值表现

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
过去三个月	29.69%	1.89%	26.07%	1.66%	3.62%	0.23%

创金合信金融地产精选股票C净值表现

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
过去三个月	29.51%	1.89%	26.07%	1.66%	3.44%	0.23%

3.2.2 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



注:1、本基金的基金合同于2018年10月11日生效,截至报告期末,本基金成立不满一年。
2、按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(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。本报告期本基金处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李爽	本基金基金经理	2018-10-11	-	6年	李爽女士,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,主要从事地产行业跟踪和股票推荐等工作。2015年6月加创金合信基金管理有限公司,历任研究部研究员、基金经理助理,现任基金经理。

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日创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金,基金经理由张荣、闫一帆变更为李爽。

4.2 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、本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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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