创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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07月18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07月17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04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数
基金主代码	005567
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年02月07日
报告期末基金份额总额	71,025,700.27份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资,力争将年化跟踪误差控制在2%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。
业绩比较基准	MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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MSCI中国A股国际指数A / 创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567 / 005568
报告期末下属分级基金的份额总额	55,545,025.71份 / 15,480,674.66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04月01日－2019年06月30日)	
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
1.本期已实现收益	987,824.74	276,294.51
2.本期利润	146,837.08	11,625.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0027	0.0007
4.期末基金资产净值	55,583,075.22	15,439,480.24
5.期末基金份额净值	1.0007	0.9973

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

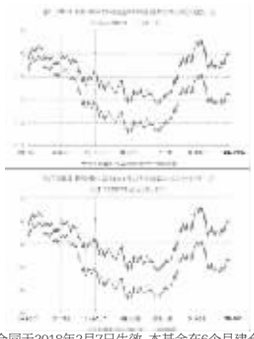
创金合信MSCI中国A股国际指数A净值表现

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	-0.26%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.95%	-0.15%

创金合信MSCI中国A股国际指数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	-0.32%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.89%	-0.15%

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:本基金的基金合同于2018年2月7日生效,本基金在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		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	11年	陈龙先生,中国国籍,复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校(UCLA)金融工程硕士,2006年7月就职于中证指数有限公司,任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所,任股指事业部高级经理,2016年3月加入创金合信基金管理有限公司,现任指数策略投资研究部副总监、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

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数,业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的,考虑了境外投资者投资A股的相关限制(外资投资比例)和流动性因素(换手率等指标),入选的样本股主要为大中盘股票，所有成分股总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为55%。本基金的投资策略,正常情况下主要采用完全复制法进行投资,力争将年化跟踪误差控制在2%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内;为了更好地实现投资目标,当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为1.0007元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.26%,同期业绩比较基准收益率为-4.21%;截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为0.9973元，本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.32%,同期业绩比较基准收益率为-4.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§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	65,727,463.27	92.15
	其中:股票	65,727,463.27	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,001,800.00	4.21
	其中:债券	3,001,800.00	4.21
	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	2,165,237.02	3.04
8	其他资产	432,841.73	0.61
9	合计	71,327,342.02	100.00

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(指数投资)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	875,817.60	1.23
B	采矿业	2,360,981.60	3.32
C	制造业	28,524,922.01	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,840,683.00	2.59
E	建筑业	1,674,629.00	2.36
F	批发和零售业	1,427,335.60	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,070,773.20	2.92
H	住宿和餐饮业	79,446.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,985,258.35	4.20
J	金融业	18,384,550.20	25.89
K	房地产业	3,281,738.00	4.62
L	租赁和商务服务业	844,255.40	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	105,543.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	448,936.70	0.63
R	文化、体育和娱乐业	412,450.00	0.58
S	综合	178,509.00	0.25
	合计	65,495,828.66	92.22

5.2.2 报告期末(积极投资)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	45,848.25	0.06
C	制造业	118,384.74	0.17
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	-	-
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	33,531.68	0.05
J	金融业	33,869.94	0.05
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	231,634.61	0.33

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600519	贵州茅台	3,300	3,247,200.00	4.57
2	601318	中国平安	28,200	2,498,802.00	3.52
3	600036	招商银行	53,600	1,928,528.00	2.72
4	000858	五粮液	10,100	1,191,295.00	1.68
5	601166	兴业银行	53,900	985,831.00	1.39
6	600000	浦发银行	76,200	890,016.00	1.25
7	601398	工商银行	139,900	824,011.00	1.16
8	600276	恒瑞医药	11,560	762,960.00	1.07
9	000002	万科A	25,300	703,593.00	0.99
10	601288	农业银行	193,200	695,520.00	0.98

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300782	卓胜微	471	51,301.32	0.07
2	600968	海油发展	12,915	45,848.25	0.06
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.05
4	601698	中国卫通	8,554	33,531.68	0.05
5	300594	朗进科技	631	27,833.41	0.04

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	3,001,800.00	4.23
	其中:政策性金融债	3,001,800.00	4.23
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	3,001,800.00	4.23

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	108603	国开1804	30,000	3,001,800.00	4.23

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1909	IF1909	1	1,137,540.00	20,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					20,880.00
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)					-17,460.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内持有少量股指期货合约,主要是为了进行多头套保,应对大额申赎和方便流动性管理。

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 2018年7月13日，宜宾五粮液股份有限公司（下称"五粮液"，股票代码:000858)从四川省纪委、监察委网站获悉宜宾市国有资产经营有限公司董事长张辉(其现任五粮液第五届董事会董事)正接受纪律审查和监察调查。张辉系宜宾市国资公司委派兼任五粮液董事。另2018年8月24日,五粮液从四川省纪委、监察委网站获悉五粮液监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法，目前正接受纪律审查和监察调查。余铭书于2012年7月从宜宾市国有资产经营有限公司调入本公司任职。
本基金投研人员分析认为,上述事项不对五粮液生产经营和长远发展产生影响,五粮液将关注后续进展情况,并按有关规定及时履行相关程序和信息披露义务。五粮液作为白酒行业龙头之一,业绩稳健,维持持有评级。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五粮液进行了投资。

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	120,858.99
2	应收证券清算款	76,129.03
3	应收股利	-
4	应收利息	75,922.84
5	应收申购款	159,930.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	432,841.73

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
5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。
5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.05	新发流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
报告期期初基金份额总额	60,012,800.34	17,197,860.75
报告期期间基金总申购份额	5,151,661.86	1,775,951.49
减:报告期期间基金总赎回份额	9,619,436.49	3,493,137.58
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	55,545,025.71	15,480,674.66

§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

单位:份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,450.09	5,000,450.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,450.09	5,000,450.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	9.00	32.30

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
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交易明细。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	14.08%	10,000,900.09	14.08%	36月
基金管理人高级管理人员	14,678.78	0.02%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,015,578.87	14.10%	10,000,900.09	14.08%	36月

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
1、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议》;
3、创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2019年第2季度报告原文。

10.2 存放地点
深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

10.3 查阅方式
www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
2019年07月18日

创金合信春来回报一年期定期开放混合型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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07月18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07月17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04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信春来回报一年定开混合
基金主代码	005799
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018年06月07日
报告期末基金份额总额	20,933,907.47份
投资目标	本基金采用动态资产配置策略,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期内采用动态资产配置策略,在相对风险较低的稳固收益资产和相对风险较高的风险资产之间进行动态配置。其中,稳固收益资产包括国债、央行票据和政策性金融债、企业债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产;风险资产包括股票、可转换债券、可交换债券,以及国债期货、权证、股指期货、股票期权等金融衍生品。基金管理人可根据市场变化情况,就稳固收益资产和风险资产的定义进行更新,并在招募说明书更新中公告。
开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性、以应付当时市场条件下的赎回要求,为保持基金的资产流动性,本基金可适当投资于货币市场工具。具体而言,本基金将根据基金资产组合中的现金存量水平,在确定总体流动性要求的基础上,综合考虑宏观经济形势、市场资金面走向、交易对手的信用资质以及各类资产收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,并定期对组合的平均剩余期限及投资品种比例进行适当调整,在保证基金资产安全性和流动性的基础上力争创造稳定的收益。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中证短债指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金,长期来看,其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、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	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	创金合信春来回报一年定开混合A / 创金合信春来回报一年定开混合C
下属分级基金的交易代码	005799 / 005800
报告期末下属分级基金的份额总额	20,897,363.96份 / 36,543.51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04月01日－2019年06月30日)	
	创金合信春来回报一年定开混合A	创金合信春来回报一年定开混合C
1.本期已实现收益	1,249,571.93	476.85
2.本期利润	999,314.96	407.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0069	0.0091
4.期末基金资产净值	20,949,432.55	38,568.65
5.期末基金份额净值	1.0025	1.0554

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

创金合信春来回报一年定开混合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	0.59%	0.02%	0.44%	0.30%	0.15%	-0.28%

创金合信春来回报一年定开混合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	6.51%	0.70%	0.44%	0.30%	6.07%	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

注:本基金的合同生效日为2018年6月7日,本基金在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		
程志田	本基金基金经理	2018-06-07	2019-06-13	12年	程志田先生,中国国籍,金融学硕士,2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理,2009年7月加入海通证券股份有限公司任金融工程总监,2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理,2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监,2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理。
郑振源	本基金基金经理	2019-06-13	-	9年	郑振源先生,中国国籍,中国人民银行研究生部经济学硕士,2009年7月加入第一创业证券研究所，担任宏观债券研究员。2012年7月加入第一创业证券资产管理部，先后担任宏观债券研究员、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司,现任基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席海外投资官、国际投资部负责人、量化投资部总监、指数策略投资部总监	2019-06-13	-	15年	董梁先生,中国香港,美国密歇根大学材料科学博士,2006年3月加入美国巴克莱环球投资者(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理、负责美股量化模型开发及投资工作。2009年8月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员、负责港股量化模型开发和投资，以及环球股指期货期权的量化投资。2011年1月加入信达国际任执行董事、基金经理，进行港股投资。2012年8月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015年加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理。2017年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席海外投资官、兼国际投资部负责人、量化投资部总监、指数策略投资研究部总监、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

回顾2019年一季度,本基对稳固收益资产和风险资产采用动态配置策略,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。其中风险资产的投资策略主要为量化选股策略,同时严格进行风险管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信春来回报一年定开混合A基金份额净值为1.0025元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.59%,同期业绩比较基准收益率为0.44%;截至报告期末创金合信春来回报一年定开混合C基金份额净值为1.0554元，本报告期内,该类基金份额净值增长率为6.51%,同期业绩比较基准收益率为0.44%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§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	8,193,440.00	39.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	8,193,440.00	39.04

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	019611	19国债01	82,000	8,193,440.00	39.04

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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	22,203.61
2	应收证券清算款	19,990,629.73
3	应收股利	-
4	应收利息	54,767,964.63
5	应收申购款	8,000,498.12
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	82,781,296.09

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
本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	创金合信恒利超短债券A	创金合信恒利超短债券C
报告期期初基金份额总额	1,685,334,472.44	2,629,277,341.91
报告期期间基金总申购份额	269,403,425.07	600,697,126.34
减:报告期期间基金总赎回份额	899,260,620.17	1,933,672,737.67
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	1,055,477,277.34	1,296,301,730.58

§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、《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信恒利超短债债券型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信恒利超短债债券型证券投资基金2019年第2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07月18日

创金合信恒利超短债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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07月18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07月17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04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信恒利超短债债券
基金主代码	006076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年08月02日
报告期末基金份额总额	2,351,779,007.92份
投资目标	本基金将投资组合的平均剩余期限控制在270天以内,力争在保持投资组合较高流动性的前提下,获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	为了保持本基金明显的收益风险特征,本基金投资组合的平均剩余期限将控制在270天以内,主要投资超短债主题证券，力争在保持投资组合较高流动性的前提下,获取超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证短融AAA指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,长期来看,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	创金合信恒利超短债债券A / 创金合信恒利超短债债券C
下属分级基金的交易代码	006076 / 006077
报告期末下属分级基金的份额总额	1,055,477,277.34份 / 1,296,301,730.58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04月01日－2019年06月30日)	
	创金合信恒利超短债债券A	创金合信恒利超短债债券C
1.本期已实现收益	14,603,801.06	17,152,928.16
2.本期利润	11,707,577.69	13,013,105.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0076
4.期末基金资产净值	1,104,025,123.54