

创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年03月31日

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:2017年04月21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。

§2 基金产品概况 基金简称:创金合信鑫价值混合 基金代码:003232 基金运作方式:契约型开放式

投资目标 追求基金资产的稳健增值。 投资策略 1.资产配置策略 本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*30%+一年期人民币定期存款利率(税后)*70% 风险收益特征 本基金为混合型偏股基金,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 中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

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。

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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

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

Table with 5 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

3.2.3 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

Table with 5 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

3.2.4 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

Table with 5 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

3.2.5 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

Table with 5 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

3.2.6 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

Table with 5 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

3.2.7 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

Table with 5 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

3.2.8 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

Table with 5 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

3.2.9 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

Table with 5 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

3.2.10 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

Table with 5 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

3.2.11 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

关监管措施,债券市场收益率整体上行,期限利差和信用利差有所扩大。一季度本基金采取稳健投资策略,在防范风险的同时为投资者赚取更优的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现 2017年第一季度创金合信鑫价值A类份额净值增长率为0.30%,C类份额净值增长率为0.10%,同期业绩比较基准增长率为1.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本报告期内未发生连续二十个工作日出现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 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 本基金本报告期末未持有国债期货。

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,或在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股票备选库的情况。

5.11.3 其他资产构成 单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额, 占基金资产净值比例(%)

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中不存在流通受限的情况。

§6 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

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的期间, 期初份额, 期末份额, 持有份额, 持有份额占比例(%)

8.2 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。

8.3 报告期内基金的投资策略和运作分析 回顾2017年一季度,我们严格执行量化模型进行投资,并严格执行风险管理,一方面,量化选股模型提供了选股依据;另一方面,仓位管理上我们严格按照模型进行择时操作。

8.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 回顾2017年一季度,我们严格执行量化模型进行投资,并严格执行风险管理,一方面,量化选股模型提供了选股依据;另一方面,仓位管理上我们严格按照模型进行择时操作。

8.5 报告期内基金的投资策略和运作分析 回顾2017年一季度,我们严格执行量化模型进行投资,并严格执行风险管理,一方面,量化选股模型提供了选股依据;另一方面,仓位管理上我们严格按照模型进行择时操作。

创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年03月31日

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:2017年04月21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。

§2 基金产品概况 基金简称:创金合信沪深300增强 基金代码:003210 基金运作方式:契约型开放式

投资目标 本基金为股票型偏股基金,采用定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过1.5%的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5% 风险收益特征 本基金为股票型偏股基金,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 招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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

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。

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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 5 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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)