创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30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:2018年07月20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2018年07月18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2018年04月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	创金合信国证A股指数
基金主代码	005414
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月28日
报告期末基金份额总额	11,688,702.69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	国证A股指数收益率×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	创金合信国证A股指数A / 创金合信国证A股指数C
下属分级基金的交易代码	005414 / 005415
报告期末下属分级基金的份额总额	5,679,811.34份 / 6,008,891.35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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)	
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
1.本期已实现收益	-14,683.99	-16,711.79
2.本期利润	-580,263.82	-594,857.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1022	-0.1027
4.期末基金资产净值	4,929,706.06	5,208,614.69
5.期末基金份额净值	0.8679	0.8668

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

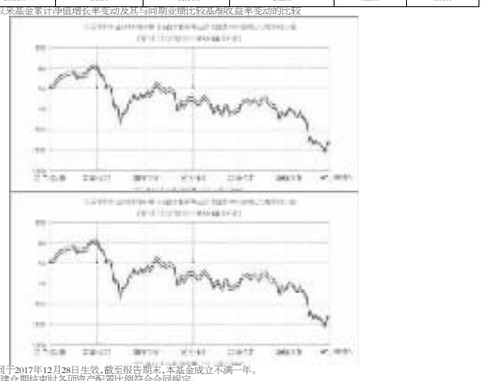
创金合信国证A股指数A净值表现

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	-10.58%	1.16%	-11.14%	1.15%	0.56%	0.01%

创金合信国证A股指数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	-10.61%	1.16%	-11.14%	1.15%	0.53%	0.01%

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2017年12月28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		
陈龙	本基金经理	2017-12-28	-	10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,负责股票现货、股指期货及其他金融衍生产品的研究开发和交易管理等工作。2016年3月加入创金合信基金管理有限公司,负责证券指数化投资策略及产品的研究分析工作,现任指数策略投资研究部副总监、基金经理。

注:1.本基金自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》(以下简称"《证券投资基金法》")、《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。本基金的投资范围、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