创金合信恒兴中短债债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:交通银行股份有限公司
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。
基金托管人交通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	创金合信恒兴中短债债券	
基金主代码	006874	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月05日	
报告期末基金份额总额	270,228,250.22份	
投资目标	本基金将投资组合的久期控制在3年以内,在保持投资组合较高流动性的前提下,力争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,本基金投资组合的久期控制在3年以内,主要投资中短债主题证券,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	中债总财富(1-3年)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信恒兴中短债债券A	创金合信恒兴中短债债券C
下属分级基金的交易代码	006874	006875
报告期末下属分级基金的份额总额	250,307,411.45份	19,920,838.77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)	
	创金合信恒兴中短债债券A	创金合信恒兴中短债债券C
1.本期已实现收益	4,283,697.83	531,430.36
2.本期利润	4,905,513.66	583,261.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0150	0.0143
4.期末基金资产净值	254,333,426.78	20,219,703.58
5.期末基金份额净值	1.0161	1.0150

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

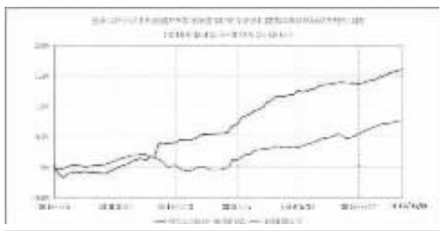
创金合信恒兴中短债债券A净值表现

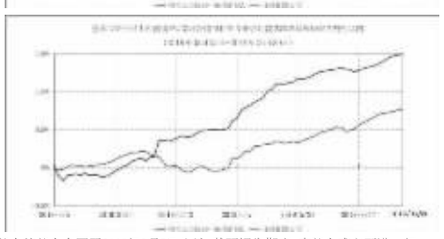
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	0.04%	0.56%	0.03%	0.92%	0.01%

创金合信恒兴中短债债券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	1.39%	0.04%	0.56%	0.03%	0.83%	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2019年3月5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		
邓振源	本基金基金经理	2019-03-05	-	9年	邓振源先生,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。
谢创	本基金基金经理	2019-03-05	-	4年	谢创先生,中国国籍,西南财经大学金融工程硕士。2015年7月加入创金合信基金管理有限公司,曾任交易部交易员,固定收益部基金经理助理,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年二季度债券市场呈现总体震荡缓降行情:短端和长端利率基本持平,期限利差变化较小、信用利差略有压缩。二季度利率水平先升后降。一方面,一季度企业集中开工和财政刺激的加快推进,信贷投放较多,经济表现短期不弱,政策短期出现微调。4月份资金面整体出现略紧,收益率从前期低位向上反弹,不过幅度总体不显著;另一方面,步入5月份,伴随华为事件显示中美贸易摩擦有所加剧,经济短期重新走弱,货币政策重新进行了微调。6月包商银行被接管事件,短期直接导致了银行间融资市场收紧,非银机构尤其受到歧视,质押券要求明显提升。央行等监管机构及时出手释放流动性,流动性危机状态得以解除。不过,非银机构及中等评级债券的质押融资能力并未得到根本修复。

向前看,债市基本面不改震荡格局。一方面,经济偏弱、政策偏松,同时利率水平总体已较低,因此债市不存在趋势性的机会和风险,行情将偏震荡。宽货币向宽信用的继续转化,将整体改善信用基本面。对于民企而言,当前政策对真实经营的优质民企融资支持较大,但市场偏见尚未显著改观,投资价值突出,弱资质民企仍需谨慎。对于城投而言,融资环境在继续改善,"妥善化解地方债务存量"的总体政策方针,以及多地区已着手推进金融机构的融资支持,多方面显示公募城投债的信用在进一步提升,尤其是公益类城投债,而产业类城投则需谨慎;城投债投资可适当下沉。考虑到部分中低等级主体仍在爆发违约事件,叠加包商事件总体加剧该类券的质押融资难度,因此中低评级利差水平短期内将难以有效压缩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信恒兴中短债债券A基金份额净值为1.0161元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.48%,同期业绩比较基准收益率为0.56%;截至报告期末创金合信恒兴中短债债券C基金份额净值为1.0150元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.39%,同期业绩比较基准收益率为0.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	234,286,867.30	83.59
	其中:债券	234,286,867.30	83.59
	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	36,050,239.83	12.86
	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	3,422,652.18	1.22
8	其他资产	6,529,989.17	2.33
9	合计	280,289,748.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

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	21,419,856.20	7.80
	其中:政策性金融债	21,419,856.20	7.80
4	企业债券	181,746,970.00	66.20
5	企业短期融资券	20,031,000.00	7.30
6	中期票据	10,407,000.00	3.79
7	可转债(可交换债)	682,041.10	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	234,286,867.30	85.33

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	112244	15国海债	239,000	24,325,420.00	8.86
2	1680008	16衡阳交投债	300,000	23,646,000.00	8.61
3	112462	16徐工02	235,000	23,497,650.00	8.56
4	112513	17华侨01	200,000	20,318,000.00	7.40
5	190201	19国开01	200,000	19,992,000.00	7.28

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大证券发行主体受到监管部门立案调查或在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约定的股票投资备选库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	39,108.35
2	应收证券清算款	1,949,705.23
3	应收股利	-
4	应收利息	4,258,723.25
5	应收申购款	282,452.34
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,529,989.17

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

	创金合信恒兴中短债债券A	创金合信恒兴中短债债券C
报告期期初基金份额总额	376,317,150.11	71,581,128.03
报告期期间基金总申购份额	4,911,294.15	8,615,344.67
减:报告期期间基金总赎回份额	130,921,032.81	60,275,633.93
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	250,307,411.45	19,920,838.77

§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、《创金合信恒兴中短债债券型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信恒兴中短债债券型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信恒兴中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

创金合信汇誉纯债六个月定期开放债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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: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	创金合信汇誉纯债六个月定开债券	
基金主代码	005784	
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26日	
报告期末基金份额总额	210,301,641.38份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极的主动管理,追求长期稳健的资本增值和当期总回报的最大化。	
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作,在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 (一)封闭期投资策略 本基金在封闭期通过对宏观经济形势的持续跟踪,基于对利率、信用等市场的分析和预测,综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等组合管理策略,力争实现基金资产的稳健增值。 (二)开放期投资策略 开放期内,本基金力保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。 未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信汇誉纯债六个月定开债券A	创金合信汇誉纯债六个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	005784	005785
报告期末下属分级基金的份额总额	210,115,250.31份	186,391.07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)	
	创金合信汇誉纯债六个月定开债券A	创金合信汇誉纯债六个月定开债券C
1.本期已实现收益	3,802,702.39	3,227.83
2.本期利润	2,778,299.57	2,324.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132	0.0125
4.期末基金资产净值	216,622,558.52	192,131.35
5.期末基金份额净值	1.0310	1.0308

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

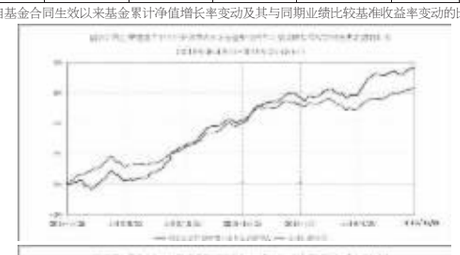
创金合信汇誉纯债六个月定开债券A净值表现

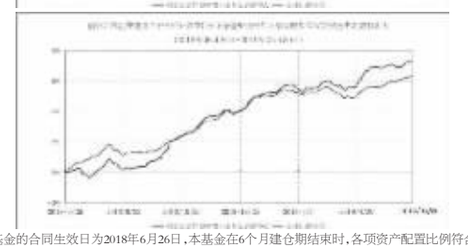
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.31%	0.07%	0.64%	0.06%	0.67%	0.01%

创金合信汇誉纯债六个月定开债券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	1.23%	0.07%	0.64%	0.06%	0.59%	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:本基金的合同生效日为2018年6月26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		
张俊	本基金基金经理	2018-08-27	2019-05-21	10年	张俊先生,中国国籍,学士。2009年加入江苏常熟农村商业银行,历任常熟农商银行金融市场部同业业务岗交易员、业务主管、同业金融部总经理助理,主要负责债券市场的投资交易,研究分析等工作。2017年4月加入创金合信基金管理有限公司固定收益部,曾任创金合信货币市场基金基金经理(2017年9月11日至2019年5月21日)、创金合信汇益纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年8月27日至2019年5月21日)、创金合信汇誉纯债六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年8月27日至2019年5月21日)。
邓振源	本基金基金经理	2019-05-21	-	9年	邓振源先生,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。
谢创	本基金基金经理	2019-05-21	-	4年	谢创先生,中国国籍,西南财经大学金融工程硕士。2015年7月加入创金合信基金管理有限公司,曾任交易部交易员,固定收益部基金经理助理,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年二季度债券市场呈现总体震荡缓降行情:短端和长端利率基本持平,期限利差变化较小,信用利差略有压缩。二季度利率水平先升后降。一方面,一季度企业集中开工和财政刺激的加快推进,信贷投放较多,经济表现短期不弱,政策短期出现微调。4月份资金面整体出现略紧,收益率从前期低位向上反弹,不过幅度总体不显著;另一方面,步入5月份,伴随华为事件显示中美贸易摩擦有所加剧,经济短期重新走弱,货币政策重新进行了微调。6月包商银行被接管事件,短期直接导致了银行间融资市场收紧,非银机构尤其受到歧视,质押券要求明显提升。央行等监管机构及时出手释放流动性,流动性危机状态得以解除。不过,非银机构及中等评级债券的质押融资能力并未得到根本修复。

向前看,债市基本面不改震荡格局。一方面,经济偏弱、政策偏松,同时利率水平总体已较低,因此债市不存在趋势性的机会和风险,行情将偏震荡。宽货币向宽信用的继续转化,将整体改善信用基本面。对于民企而言,当前政策对真实经营的优质民企融资支持较大,但市场偏见尚未显著改观,投资价值突出,弱资质民企仍需谨慎。对于城投而言,融资环境在继续改善,"妥善化解地方债务存量"的总体政策方针,以及多地区已着手推进金融机构的融资支持,多方面显示公募城投债的信用在进一步提升,尤其是公益类城投债,而产业类城投则需谨慎;城投债投资可适当下沉。考虑到部分中低等级主体仍在爆发违约事件,叠加包商事件总体加剧该类券的质押融资难度,因此中低评级利差水平短期内将难以有效压缩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信汇誉纯债六个月定开债券A基金份额净值为1.0310元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.31%,同期业绩比较基准收益率为0.64%;截至报告期末创金合信汇誉纯债六个月定开债券C基金份额净值为1.0308元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.23%,同期业绩比较基准收益率为0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	274,710,893.00	94.40
	其中:债券	274,710,893.00	94.40
	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	10,073,829.94	3.46
8	其他资产	6,208,923.58	2.13
9	合计	290,993,646.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

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	30,441,000.00	14.04
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	152,034,500.00	70.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	92,151,500.00	42.50
7	可转债(可交换债)	83,893.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	274,710,893.00	126.70

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	101900523	19晋交投MTN001	200,000	20,448,000.00	9.43
2	143221	17海资02	200,000	20,316,000.00	9.37
3	136036	15苏元禾	200,000	20,314,000.00	9.37
4	101900669	19顺义国资MTN001	200,000	20,272,000.00	9.35
5	136595	16利田03	200,000	19,278,000.00	8.89

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	9,187.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,199,736.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,208,923.58

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

	创金合信汇誉纯债六个月定开债券A	创金合信汇誉纯债六个月定开债券C
报告期期初基金份额总额	210,114,649.71	186,207.05
报告期期间基金总申购份额	600.60	184.02
减:报告期期间基金总赎回份额	0.00	0.00
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	210,115,250.31	186,391.07

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401 - 20190630	60,001,700.00	0.00	0.00	60,001,700.00	28.53%
	2	20190401 - 20190630	100,003,500.00	0.00	0.00	100,003,500.00	47.55%
	3	20190401 - 20190630	50,001,250.00	0.00	0.00	50,001,250.00	23.78%

产品持有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能会存在以下风险:
1.大额申购风险
在发生投资者大额申赎时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。
2.大额赎回风险
①若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;
②若持有基金份额比例达到或超过基金份额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;
③基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;
④对基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;
⑤大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。
本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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、《创金合信汇誉纯债六个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信汇誉纯债六个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信汇誉纯债六个月定期开放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

创金合信国企活力混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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: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	创金合信国企活力混合
基金主代码	004112
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月23日
报告期末基金份额总额	57,854,514.03份
投资目标	通过精选个股和风险控制,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取"自上而下"的大类资产配置框架,综合宏观经济走势、货币市场、资本市场表现,以及国家重大政治、经济与产业政策等政策因素,形成对大类资产预期风险及预期收益水平的判断,进而确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+一年期人民币定期存款利率(税后)*20%
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	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04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	2,349,386.33
2.本期利润	-2,070,592.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0340
4.期末基金资产净值	58,257,209.27
5.期末基金份额净值	1.007

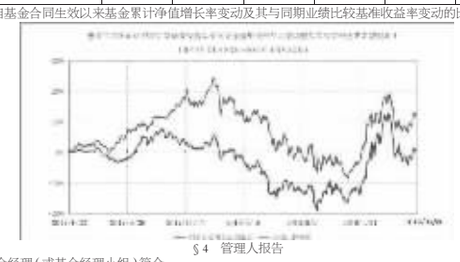
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.28%	1.44%	-0.78%	1.22%	-3.50%	0.22%

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	2017-01-23	-	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4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。

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