创金合信聚利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: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	聚利债券
基金主代码	001199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月15日
报告期末基金份额总额	22,398,982.23份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。 回购套利策略是本基金重要的操作策略之一,把信用产品投资和回购交易结合起来,管理人根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来博取超额收益,或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。 当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时,本基金可以直接参与股票市场投资,努力获取超额收益。在股市场投资过程中,本基金主要采取自下向上的投资策略,利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法,对以下三类上市公司进行投资: (1)现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红记录或现金分红潜力的优质上市公司; (2)投资价值明显被市场低估的上市公司; (3)未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,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	创金合信聚利债券A	创金合信聚利债券C
下属分级基金的交易代码	001199	001200
报告期末下属分级基金的份额总额	16,368,180.80份	6,030,801.43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)	
	创金合信聚利债券A	创金合信聚利债券C
1.本期已实现收益	159,564.17	49,726.61
2.本期利润	244,557.16	72,243.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0128
4.期末基金资产净值	18,467,449.21	6,682,278.37
5.期末基金份额净值	1.128	1.108

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

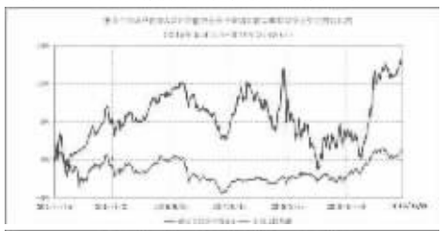
创金合信聚利债券A净值表现

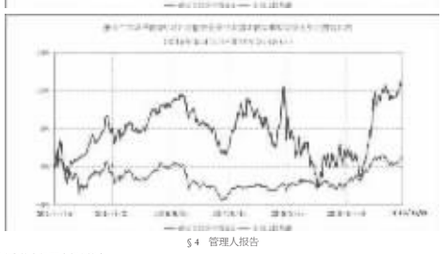
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.25%	-0.27%	0.14%	1.62%	0.11%

创金合信聚利债券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	1.28%	0.26%	-0.27%	0.14%	1.55%	0.12%

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		
王一兵	本基金基金经理、固定收益部总监	2015-05-15	-	15年	王一兵先生,中国国籍,四川大学MBA,曾任职于四川和正期货公司,2009年3月加入第一创业证券股份有限公司,历任固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监,2014年8月加入创金合信基金管理有限公司,现任固定收益部总监,基金经理。
邓振源	本基金基金经理	2015-05-15	-	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。
张荣	本基金基金经理	2015-06-11	-	9年	张荣先生,中国国籍,北京大学金融学硕士,2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作,历任多家银行监管员,2010年加入第一创业证券资产管理部,历任金融行业研究主管、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担任高级研究员,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年二季度债券市场呈现总体震荡规绪行情: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聚利债券A基金份额净值为1.128元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.35%,同期业绩比较基准收益率为-0.27%;截至报告期末创金合信聚利债券C基金份额净值为1.108元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.28%,同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

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	4,655,750.00	17.75
	其中:股票	4,655,750.00	17.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,515,671.20	78.23
	其中:债券	20,515,671.20	78.23
	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	645,041.10	2.46
8	其他资产	407,240.73	1.55
9	合计	26,223,703.03	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	-	-
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	-	-
J	金融业	4,655,750.00	18.51
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	4,655,750.00	18.51

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	601318	中国平安	10,000	886,100.00	3.52
2	600036	招商银行	23,000	827,540.00	3.29
3	601328	交通银行	124,000	758,880.00	3.02
4	601939	建设银行	100,000	744,000.00	2.96
5	601166	兴业银行	40,000	731,600.00	2.91
6	600015	华夏银行	91,900	707,630.00	2.81

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	7,453,860.00	29.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,531,500.00	6.09
	其中:政策性金融债	1,531,500.00	6.09
4	企业债券	11,530,311.20	45.85
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	20,515,671.20	81.57

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	010303	03国债(3)	39,000	3,944,460.00	15.68
2	010107	21国债(7)	21,000	2,160,480.00	8.59
3	112244	15国海债	17,090	1,739,420.20	6.92
4	018006	国开1702	15,000	1,531,500.00	6.09
5	136171	16华证01	15,000	1,512,600.00	6.01

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	1,778.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	306,068.21
5	应收申购款	99,393.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	407,240.73

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
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

	创金合信聚利债券A	创金合信聚利债券C
报告期期初基金份额总额	18,500,914.80	5,945,387.19
报告期期间基金总申购份额	1,512,352.06	3,006,274.73
减,报告期期间基金总赎回份额	3,645,086.06	2,920,860.49
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	16,368,180.80	6,030,801.43

§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、《创金合信聚利债券型证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信聚利债券型证券投资基金托管协议》;
3、创金合信聚利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

创金合信国证2000指数发起式证券投资基金

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	创金合信国证2000指数
基金主代码	005565
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	11,365,574.29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2000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2000指数A	创金合信国证2000指数C
下属分级基金的交易代码	005565	005566
报告期末下属分级基金的份额总额	5,521,471.54份	5,844,102.75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)	
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
1.本期已实现收益	285,255.14	316,469.89
2.本期利润	-418,066.61	-444,484.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0762	-0.0746
4.期末基金资产净值	5,193,450.03	5,487,906.86
5.期末基金份额净值	0.9406	0.9391

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

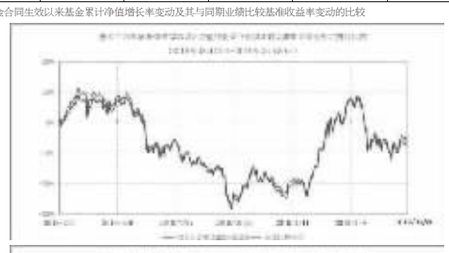
创金合信国证2000指数A净值表现

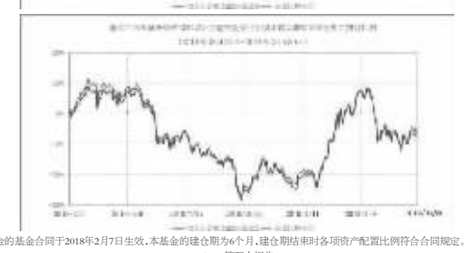
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.45%	1.84%	-8.99%	1.84%	1.54%	0.00%

创金合信国证2000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	-7.43%	1.84%	-8.99%	1.84%	1.56%	0.00%

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,任投指事业部高级经理,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

报告期内本基金紧密跟踪标的指数,业绩基准为国证2000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。国证2000指数的样本股由:在深圳、上海证券交易所上市的除ST、*ST股票外,按照市值和成交金额在市场中所占比例的综合排名,扣除国证1000指数样本股后,排名靠前的2000只股票构成。该指数于2014年3月28日发布,用以反映A股市场小盘股票的价格变动趋势。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国证2000指数A基金份额净值为0.9406元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-7.45%,同期业绩比较基准收益率为-8.99%;截至报告期末创金合信国证2000指数C基金份额净值为0.9391元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-7.43%,同期业绩比较基准收益率为-8.99%。

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	10,039,328.23	93.61
	其中:股票	10,039,328.23	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	320,192.00	2.99
	其中:债券	320,192.00	2.99
	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	354,820.63	3.31
8	其他资产	10,679.42	0.10
9	合计	10,725,020.28	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	147,937.40	1.39
B	采矿业	42,664.00	0.40
C	制造业	6,498,383.10	60.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	252,568.04	2.36
E	建筑业	290,252.00	2.72
F	批发和零售业	594,044.20	5.56
G	交通运输、仓储和邮政业	267,889.10	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	911,753.74	8.54
J	金融业	47,265.00	0.44
K	房地产业	315,395.80	2.95
L	租赁和商务服务业	92,323.60	0.86
M	科学研究和技术服务业	221,301.85	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	160,588.40	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,459.00	0.29
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	71,427.00	0.67
S	综合	95,076.00	0.89
	合计	10,039,328.23	93.99

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
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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	603686	龙马环卫	2,000	39,760.00	0.37
2	600557	康缘药业	2,600	38,636.00	0.36
3	600529	山东药玻	1,624	36,994.72	0.35
4	002329	皇氏集团	7,500	36,975.00	0.35
5	600305	恒顺醋业	1,980	36,471.60	0.34
6	300463	迈克生物	1,400	35,182.00	0.33
7	600363	联创光电	2,600	34,736.00	0.33
8	600284	浦东建设	4,300	33,110.00	0.31
9	002557	洽洽食品	1,300	32,825.00	0.31
10	000739	普洛药业	3,200	31,456.00	0.29

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
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	320,192.00	3.00
	其中:政策性金融债	320,192.00	3.00
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	320,192.00	3.00

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	3,200	320,192.00	3.00

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	1,484.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,118.83
5	应收申购款	1,076.40
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,679.42

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。
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
本基金本报告期末持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
报告期期初基金份额总额	5,447,839.97	5,876,875.47
报告期期间基金总申购份额	216,621.23	1,208,173.72
减,报告期期间基金总赎回份额	142,989.66	1,240,946.44
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	5,521,471.54	5,844,102.75

§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

	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,200.04	5,000,200.00
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	5,000,200.04	5,000,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	90.56	85.56

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	10,000,400.04	87.99%	10,000,400.04	87.99%	36月
基金管理人高级管理人员	5,586.65	0.05%	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	10,005,986.69	88.04%	10,000,400.04	87.99%	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

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	10,000,400.04	0.00	0.00	10,000,400.04	87.99%

产品特有风险

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购时,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总额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)因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。

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、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》;
2、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金托管协议》;
3、创金合信国证2000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

创金合信工业周期精选股票型发起式证券投资基金

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