

创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金

2016年第3季度报告

2016年09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：2016年10月24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2016年10月20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2016年07月1日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信鑫优选混合
基金主代码	002101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月19日
报告期末基金份额总额	377,223,659.89份
投资目标	追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架，基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法，综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素，形成各资产类别预期收益与预期风险的判断，并进而确定股票、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×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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫优选混合A	创金合信鑫优选混合C
下属分级基金的交易代码	002101	002102
报告期末下属分级基金的份额总额	430,264.28份	376,793,395.61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（2016年07月01日-2016年09月30日）	
	创金合信鑫优选混合A	创金合信鑫优选混合C
1. 本期已实现收益	16,697.59	7,051,167.43
2. 本期利润	15,565.30	6,805,719.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0303	0.0292
4. 期末基金资产净值	458,182.74	397,844,612.47
5. 期末基金份额净值	1.065	1.056

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

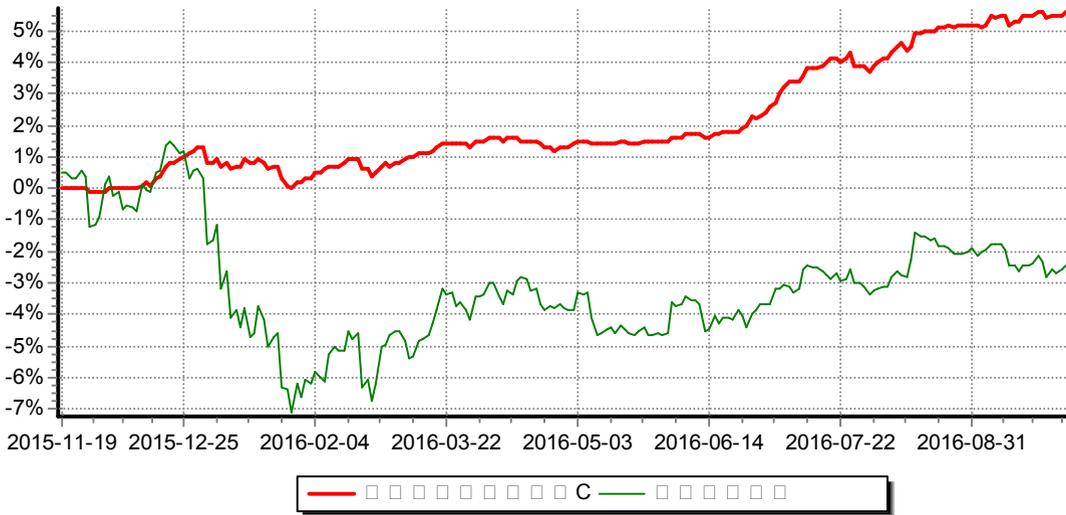
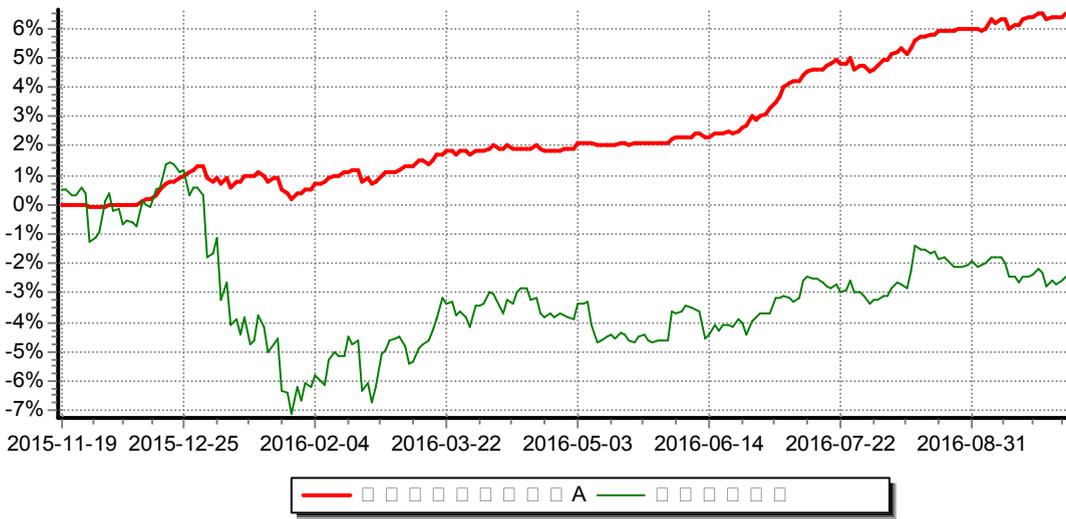
创金合信鑫优选混合A

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	3.30%	0.12%	1.24%	0.24%	2.06%	-0.12%

创金合信鑫优选混合C

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	3.13%	0.13%	1.24%	0.24%	1.89%	-0.11%

### 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		
郑振源	基金经理	2015年11月25日	—	7	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。
张荣	基金经理	2015年11月19日	—	6	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公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

## 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、《创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

本报告期内，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）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场收益率整体性下移，曲线维持平坦化，收益率平均下行20bp左右。短端金融债和超长利率债的下行幅度要更大，其中30年国债下行20bp，20年政策性金融债下行达40-50bp。从市场行情的走势逻辑来看，主要原因在于，一方面，市场对经济基本面有担忧。一二线城市房地产市场受调控，并带动地产投资短期下行；民间投资，尤其是制造业投资明显下挫。另一方面，三季度银行理财及委外资金等加大配置需求，成为市场较大的买盘，推动收益率下行。信用利差继续压缩，随着经济短期持续回暖，地方政府维护企业杠杆，信用风险有所降低。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A级净值增长率为3.30%，C级净值增长率为3.13%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,348,606.26	10.62
	其中：股票	42,348,606.26	10.62
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	333,421,271.20	83.61
	其中：债券	333,421,271.20	83.61
	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	15,596,225.72	3.91
8	其他资产	7,396,889.80	1.85
9	合计	398,762,992.98	100.00

## 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

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,009,140.00	0.25
B	采矿业	—	—
C	制造业	30,266,539.48	7.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	69,256.79	0.02
F	批发和零售业	2,155,150.00	0.54
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	2,750,150.00	0.69
J	金融业	550,609.99	0.14
K	房地产业	3,070,050.00	0.77
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	987,660.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,490,050.00	0.37
S	综合	—	—
	合计	42,348,606.26	10.63

### 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

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（%）
1	002065	东华软件	84,750	1,745,850.00	0.44
2	300298	三诺生物	62,700	1,226,412.00	0.31
3	300199	翰宇药业	51,000	1,124,040.00	0.28
4	002154	报喜鸟	230,000	1,078,700.00	0.27
5	002004	华邦健康	109,000	1,039,860.00	0.26
6	603001	奥康国际	48,000	1,005,600.00	0.25
7	300255	常山药业	121,000	998,250.00	0.25
8	002463	沪电股份	190,000	993,700.00	0.25
9	600664	哈药股份	107,900	991,601.00	0.25
10	300244	迪安诊断	31,000	987,660.00	0.25

### 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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	20,003,500.00	5.02
2	央行票据	—	—
3	金融债券	122,415,000.00	30.73
	其中：政策性金融债	122,415,000.00	30.73
4	企业债券	23,710,771.20	5.95
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	167,292,000.00	42.00
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	333,421,271.20	83.71

#### 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

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 (%)
1	150207	15国开07	900,000	92,007,000.00	23.10
2	1382282	13铁道MTN1	300,000	30,855,000.00	7.75
3	150212	15国开12	300,000	30,408,000.00	7.63
4	124999	13武续债	212,920	23,710,771.20	5.95
5	1013610 15	13长沙轨交 MTN001	200,000	21,704,000.00	5.45

#### 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的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	79,931.97
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	7,316,957.83
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,396,889.80

#### 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情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信鑫优选混合A	创金合信鑫优选混合C
--	------------	------------

报告期期初基金份额总额	376,671.47	200,193,296.07
报告期期间基金总申购份额	315,087.02	177,716,934.07
减：报告期期间基金总赎回份额	261,494.21	1,116,834.53
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—
报告期期末基金份额总额	430,264.28	376,793,395.61

## § 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

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

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、《创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金2016年第三季度报告原文

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华一路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

二〇一六年十月二十四日