

创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

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	创金合信沪深300增强
基金主代码	002310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月31日
报告期末基金份额总额	10,150,583.43份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取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7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金的投资策略为严格的指数增强策略。投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。在保证基金流动性的前提下，通过量化模型严格控制本基金与业绩比较基准之间的偏离，并追求增强收益的最大化。
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	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
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	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	002310	002315
报告期末下属分级基金的份额总额	5,078,320.03份	5,072,263.40份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

§ 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）	
	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300增强C
1. 本期已实现收益	149,977.07	150,489.87
2. 本期利润	278,900.56	281,527.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0553	0.0554
4. 期末基金资产净值	4,782,613.94	4,773,560.11
5. 期末基金份额净值	0.9418	0.9411

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

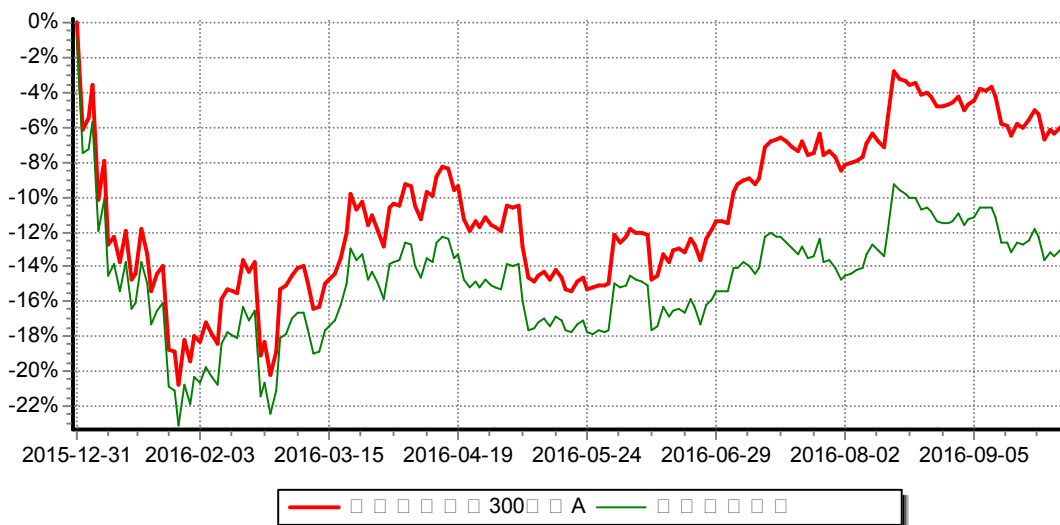
创金合信沪深300增强A

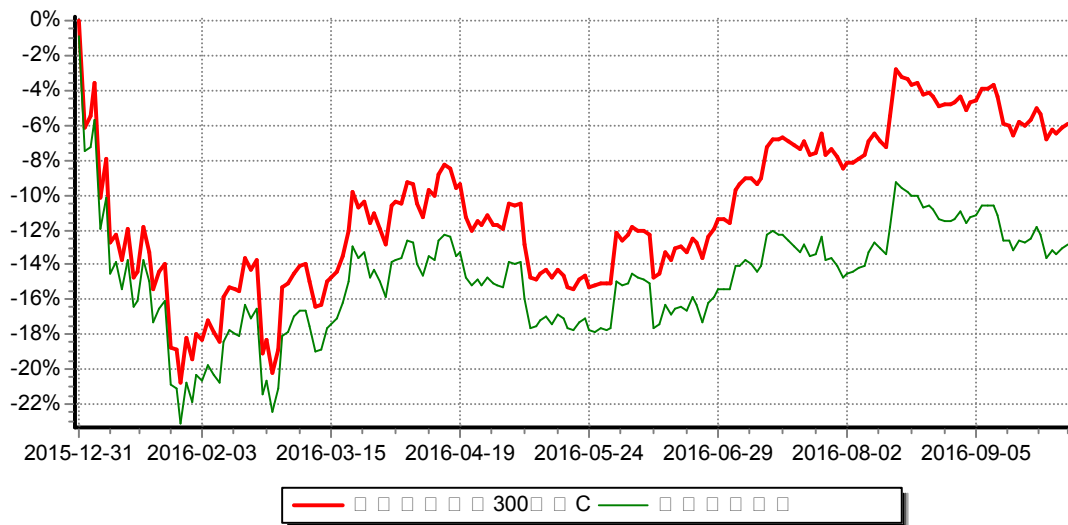
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.27%	0.77%	3.02%	0.76%	3.25%	0.01%

创金合信沪深300增强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	6.24%	0.77%	3.02%	0.76%	3.22%	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





§ 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		
程志田	基金经理、 量化投资部 总监	2015年12月 31日		10	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创

					金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监。
庞世恩	基金经理	2016年01月08日		5	<p>庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。</p> <p>2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。</p>

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、《创金合信沪深300指数增强型发起式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

回顾2016年三季度，在经历了二季度市场调整之后，股市以震荡小幅上涨为主，期间大盘股风格战胜小盘股风格，部分优质个股已经在三季度获得不错的涨幅，显示投资者信心在恢复。沪深300指数期间收益率为3.15%。

在投资管理上，我们严格依据量化模型进行指数增强投资，并严格进行风险管理。在小盘股明显跑输大盘股的过程中，本基金相对业绩基准仍能取得较为稳健的超额收益，说明本基金严格控制了行业和大小盘风格风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金A级净值增长率6.27%，C级净值增长率6.24%，同期业绩比较基准收益率为3.02%。

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，不适用本项要求。

§ 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	9,048,309.12	94.11
	其中：股票	9,048,309.12	94.11
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	564,402.55	5.87
8	其他资产	1,614.69	0.02
9	合计	9,614,326.36	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	209,799.00	2.20
C	制造业	2,246,428.92	23.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	388,679.00	4.07
E	建筑业	246,705.00	2.58
F	批发和零售业	190,764.00	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	144,186.00	1.51
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,750.00	0.66
J	金融业	3,149,709.20	32.96
K	房地产业	221,670.00	2.32
L	租赁和商务服务业	72,726.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	103,600.00	1.08
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	159,070.00	1.66
S	综合	—	—

	合计	7,196,087.12	75.30
--	----	--------------	-------

5.2.2 报告期末（积极投资）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	994,871.00	10.41
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	98,550.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	157,612.00	1.65
H	住宿和餐饮业	38,560.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,347.00	1.95
J	金融业	—	—
K	房地产业	212,076.00	2.22
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	58,500.00	0.61
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	105,706.00	1.11
S	综合	—	—
	合计	1,852,222.00	19.38

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 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

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	601318	中国平安	13,400	457,744.00	4.79
2	600016	民生银行	44,200	409,292.00	4.28
3	600837	海通证券	13,700	217,967.00	2.28
4	601166	兴业银行	13,400	213,998.00	2.24
5	601668	中国建筑	29,100	179,547.00	1.88
6	000002	万科A	6,600	172,722.00	1.81
7	601328	交通银行	27,400	151,522.00	1.59
8	600000	浦发银行	8,570	141,319.30	1.48
9	600104	上汽集团	6,400	139,840.00	1.46
10	601288	农业银行	38,100	119,253.00	1.25

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

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	000889	茂业通信	4,700	73,367.00	0.77
2	002173	*ST创疗	3,100	63,519.00	0.66
3	300214	日科化学	7,500	62,850.00	0.66
4	600888	新疆众和	7,700	61,831.00	0.65
5	600791	京能置业	7,600	61,788.00	0.65

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据		—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 2015年11月26日，海通证券（代码600837）收到中国证监会的立案调查通知书，因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对其进行立案调查。

本基金投研人员分析认为，在被中国证监会调查后该公司经营状况正常，并未受到额外过多的影响。另外，本基金为被动投资为主的指数类增强基金，海通证券（600837）作为指数成分股，并且其为行业内标杆股票，基金经理依据量化模型判断

其值得配置。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对海通证券（600837）进行了投资。

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	1,399.63
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	115.66
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,614.69

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

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

本基金本报告期末积极投资前五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

	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强C
报告期期初基金份额总额	5,022,794.96	5,052,522.74
报告期期间基金总申购份额	82,375.92	107,394.07
减：报告期期间基金总赎回份额	26,850.85	87,653.41
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	5,078,320.03	5,072,263.40

§ 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

	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	—	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	98.46	98.58

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 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、《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 2、《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 3、创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金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.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇一六年十月二十四日