

# 创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

## 2017年第二季度报告

2017年06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:2017年07月19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2017年7月14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2017年4月1日起至6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	252,519,176.78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。
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	215, 051, 880. 19份	37, 467, 296. 59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(2017年04月01日 - 2017年06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	4, 286, 156. 41	687, 479. 95
2. 本期利润	14, 477, 708. 76	1, 956, 315. 26
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0674	0. 0666
4. 期末基金资产净值	229, 677, 363. 10	40, 254, 530. 32
5. 期末基金份额净值	1. 0680	1. 0744

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净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.73%	0.56%	5.81%	0.59%	0.92%	-0.03%

##### 创金合信沪深300增强C净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.71%	0.56%	5.81%	0.59%	0.90%	-0.03%

#### 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

创金合信沪深300增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月31日-2017年06月30日)



创金合信沪深300增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月31日-2017年06月30日)



## § 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	2015-12-31	-	10年	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、基金经理

					。
庞世恩	基金经理	2016-01-08	-	6年	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。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共2次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2017年二季度，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，量化选股模型提供了选股依据；另一方面，仓位管理上我们严格按照量化择时模型进行操作。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为6.73%，C类净值增长率为6.71%，同期业绩比较基准收益率为5.81%。

#### 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	256,198,402.87	94.61
	其中：股票	256,198,402.87	94.61
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	14,342,109.87	5.30
8	其他资产	242,794.60	0.09
	合计	270,783,307.34	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
----	------	---------	----------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,466,724.00	4.99
C	制造业	62,389,160.58	23.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,713,340.00	2.49
E	建筑业	11,217,714.00	4.16
F	批发和零售业	4,378,208.00	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	5,550,824.00	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,759,234.86	1.39
J	金融业	86,968,470.10	32.22
K	房地产业	3,911,665.00	1.45
L	租赁和商务服务业	1,533,094.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,492,796.00	1.66
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	2,725,548.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	207,106,778.54	76.73

### 5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,877,272.00	1.44
C	制造业	19,279,675.33	7.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,414,740.00	0.52



E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,261,642.00	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,435,700.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,061,957.00	1.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,030,937.00	1.86
L	租赁和商务服务业	1,515,341.00	0.56
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	214,360.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	49,091,624.33	18.19

### 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	600519	贵州茅台	20,200	9,531,370.00	3.53
2	601318	中国平安	183,600	9,108,396.00	3.37
3	601628	中国人寿	336,600	9,081,468.00	3.36
4	601398	工商银行	1,664,400	8,738,100.00	3.24
5	600104	上汽集团	251,500	7,809,075.00	2.89
6	601668	中国建筑	754,000	7,298,720.00	2.70
7	000651	格力电器	168,300	6,928,911.00	2.57
8	600030	中信证券	355,400	6,048,908.00	2.24
9	000725	京东方 A	1,362,000	5,665,920.00	2.10

10	601006	大秦铁路	661,600	5,550,824.00	2.06
----	--------	------	---------	--------------	------

#### 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末公允价值 (元)	公允价值占基 金资产净值比 例(%)
1	601898	中煤能源	659,400	3,877,272.00	1.44
2	000046	泛海控股	443,300	3,870,009.00	1.43
3	600998	九州通	165,200	3,561,712.00	1.32
4	603077	和邦生物	595,500	3,031,095.00	1.12
5	000898	鞍钢股份	484,200	2,740,572.00	1.02

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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名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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2016年8月22日，全国股转系统下发《关于对中信证券股份有限公司采取出具责令改正自律监管措施的决定》，认定 2016年5月底以前，中信证券在投资者适当性管理过程中，未依据委托代理协议签署日前一交易日日终的投资者名下证券类资产市值判断适当性，而是错误根据投资者临拒办理业务权限开通手续时点的实时资产市值，为506户不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限，决定对其采取责令改正的自律监管措施。

2017年2月8日，深圳证监局下发《关于对中信证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》，认定中信证券北京好运街营业部未经公司审批同意擅自在公司官网和“券商中国”微信公众号发布“2016年双11活动宣传推介材料”，宣传推介材料部分表述片面强调收益，采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

2017年5月24日，中信证券股份有限公司（下称“中信证券”，股票代码：600030）收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57号），认定公司违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31号）第十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年”“证券公司不得向其融资、融券”的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为，并责令改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款；同时对笪新亚、宋成给予警告，并分别处以人民币10万元罚款。

本基金投研人员分析认为，在监管机构的指导下，中信证券持续完善相关内控机制，并且承诺将进一步加强日常经营管理，依法合规地开展各项业务。目前公司的经营情况正常，另外罚款对业绩影响有限。该公司作为证券行业龙头之一，目前估值处于底部区域，维持持有评级。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中信证券进行了投资。

5.11.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出股票备选库的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	119,709.95
2	应收证券清算款	114,362.83
3	应收股利	-
4	应收利息	3,310.08
5	应收申购款	5,411.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	242,794.60

**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 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	214,821,785.96	33,349,039.61
报告期期间基金总申购份额	393,415.40	12,270,859.75
减：报告期期间基金总赎回份额	163,321.17	8,152,602.77
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	215,051,880.19	37,467,296.59

**§ 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**

	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	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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基	2.33	13.34

金总份额比例 (%)		
------------	--	--

## 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	10,000,00 0.00	3.96	10,000,000 .00	3.96	36月
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,00 0.00	3.96	10,000,000 .00	3.96	-

## § 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	20170401 -2017063 0	166,822,020.6 4	0.00	0.00	166,822,020.6 4	66.06
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2017年第二季度报告原文。

### 10.2 存放地点

深圳市福田区福华一路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  
二〇一七年七月十九日