

创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金

2017年第3季度报告

2017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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年10月27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2017年10月25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7月7日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信鼎鑫睿选定开混合
场内简称	创金睿选
基金主代码	501035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月07日
报告期末基金份额总额	215,825,032.50份
投资目标	在合理控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济，行业轮动效应与定向增发项目优势的深入研究，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
业绩比较基准	中证定向增发事件指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×25%
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（2017年07月07日 - 2017年09月30日）
1. 本期已实现收益	156,927.39
2. 本期利润	551,618.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0026
4. 期末基金资产净值	216,376,651.00
5. 期末基金份额净值	1.0026

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. 本基金合同生效日为2017年7月7日，截至报告期末，本基金成立不满一个季度。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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
自基金合同生效起至今	0.26%	0.23%	3.58%	0.64%	-3.32%	-0.41%

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

创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年07月07日-2017年09月30日)



注：1、本基金的基金合同于2017年7月7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（第十三部分二、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		
曹春林	基金经理	2017-07-07	-	13年	曹春林先生，中国国籍，厦门大学经济学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作，2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作，成功操作了A股市场仅有的两例从二级市场收购并控股上市公司的案例，对上

					<p>市公司的运作转型和并购重组有深刻的理解，擅长从实业的独特视角去看待资本市场，2010年4月加盟第一创业证券，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。曾获《证券时报》“2013中国最佳财富管理机构评选”最佳资管产品经理；2014年获《中国基金报》“第一届中国最佳基金经理评选”三年期权益类投资最佳投资主办。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，现任研究部副总监。</p>
王一兵	基金经理、固定收益部总监	2017-07-10	-	13年	<p>王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业，作为公司上市代表任海南中商期货交易所红马甲。1997年进入股票市场，经历了各种证券市场的大幅涨跌变化，拥有成熟的投资心态和丰富的投资经验。曾历任第一创业证券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。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人。熟悉债券市场和固定收益产品的各种投资技巧，尤其精通近两年发展迅速的信用债，对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。</p>
张荣	基金经理	2017-07-10	-	7年	<p>张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下，把握行业趋势；20</p>

					04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合规守信情况说明

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，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

由于周期向上企业盈利增加，利率在未来一段时间维持稳定，政府鼓励直接融资呵护股市发展，因此我们看多权益市场，着重看好银行、周期、消费升级和电子网络高科技等细分领域。

2017年三季度债券市场窄幅震荡，收益率总体走平。受环保限产、气候等因素影响，三季度经济生产端总体有所转弱，需求端则主要来自基建投资的回落；货币政策保持对银行体系的流动性稳定，稳健中性基调

不变，但非银机构受银行MPA考核、超储率偏低边际扰动大等影响，融资成本明显抬升；监管措施在央行统筹协调下，有序推进，对市场冲击转弱。总体而言，债券市场缺乏明显的利多利空消息，呈现震荡局面。基金组合采取稳健的投资策略，在防范流动性、信用风险的基础上，力图获得稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，创金合信鼎鑫睿选定开混合净值增长率为0.26%，同期业绩比较基准收益率为3.58%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,757,854.27	17.45
	其中：股票	62,757,854.27	17.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	274,925,969.20	76.44
	其中：债券	274,925,969.20	76.44
	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	13,367,838.89	3.72
8	其他资产	8,598,701.60	2.39
9	合计	359,650,363.96	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)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,824,420.00	0.84
C	制造业	11,595,203.34	5.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	544,580.00	0.25
E	建筑业	4,166,258.00	1.93
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,263,324.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
J	金融业	41,172,043.00	19.03
K	房地产业	2,116,948.00	0.98
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	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	62,757,854.27	29.00

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	156,500	8,476,040.00	3.92
2	600519	贵州茅台	7,700	3,985,828.00	1.84

3	600036	招商银行	149,600	3,822,280.00	1.77
4	601166	兴业银行	184,500	3,190,005.00	1.47
5	600016	民生银行	352,800	2,829,456.00	1.31
6	600887	伊利股份	99,600	2,739,000.00	1.27
7	601328	交通银行	413,000	2,610,160.00	1.21
8	600030	中信证券	120,200	2,186,438.00	1.01
9	601288	农业银行	566,800	2,165,176.00	1.00
10	600000	浦发银行	166,900	2,148,003.00	0.99

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	224,246,000.00	103.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	50,679,969.20	23.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	274,925,969.20	127.06

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	132009	17中油EB	200,000	20,360,000.00	9.41
2	113011	光大转债	181,700	20,245,014.00	9.36
3	112328	16曲文01	200,000	19,930,000.00	9.21
4	112312	16徐工01	200,000	19,696,000.00	9.10

				0	
5	136247	16华综01	200,000	19,558,000.00	9.04

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 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在编制日前一年内受到公开谴责、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	40,882.33
2	应收证券清算款	2,524,791.62
3	应收股利	-
4	应收利息	5,971,364.37
5	应收申购款	-

6	其他应收款	61,663.28
7	其他	-
8	合计	8,598,701.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	名称	公允价值	公允价值占基金资产净值比例 (%)
1	113011	光大转债	20,245,014.00	9.36
2	110032	三一转债	9,907,595.20	4.58

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

基金合同生效日的基金份额总额	215,825,033.02
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	0.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	215,825,032.50

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		超过20%的时间区间					
机构	1	20170707 -20170930	0.00	90,007,100.00	-	90,007,100.00	41.70

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。

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、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 2、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 3、创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金 (LOF) 2017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

二〇一七年十月二十七日