

# 创金合信转债精选债券型证券投资基金

2018 年第 3 季度报告

2018 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:2018 年 10 月 25 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示 .....                                       | 3  |
| §2 基金产品概况 .....                                     | 3  |
| 转型后 .....   | 3  |
| 转型前 .....   | 4  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 .....                              | 5  |
| 3.1 主要财务指标(转型后) .....                               | 5  |
| 3.1 主要财务指标(转型前) .....                               | 5  |
| 3.2 基金净值表现(转型后) .....                               | 6  |
| 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 .....          | 6  |
| 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 ..... | 6  |
| 3.2 基金净值表现(转型前) .....                               | 7  |
| 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 .....          | 7  |
| 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 ..... | 7  |
| §4 管理人报告 .....                                      | 8  |
| 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 .....                           | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....                    | 9  |
| 4.3 公平交易专项说明 .....                                  | 9  |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况 .....                             | 9  |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明 .....                             | 9  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 .....                          | 10 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 .....                               | 10 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....                     | 10 |
| §5 投资组合报告(转型后) .....                                | 10 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 .....                              | 10 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                          | 11 |
| 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 .....          | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                        | 11 |
| 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 .....          | 12 |
| 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 .....      | 12 |
| 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 .....         | 12 |
| 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 .....          | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                      | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                     | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注 .....                                 | 12 |
| §5 投资组合报告(转型前) .....                                | 14 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 .....                              | 14 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                          | 14 |
| 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 .....          | 14 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                        | 14 |
| 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 .....          | 15 |
| 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 .....      | 15 |
| 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 .....         | 15 |
| 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 .....          | 15 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                      | 15 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                     | 15 |
| 5.11 投资组合报告附注 .....                                 | 16 |
| §6 开放式基金份额变动(转型后) .....                             | 17 |

|   |    |
|---|----|
| §6 开放式基金份额变动(转型前) .....                 | 17 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后) .....        | 18 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 .....              | 18 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前) .....        | 18 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 .....              | 18 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 18 |
| 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 ..... | 18 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 18 |
| §9 备查文件目录 .....                         | 19 |
| 9.1 备查文件目录 .....                        | 19 |
| 9.2 存放地点 .....                          | 19 |
| 9.3 查阅方式 .....                          | 19 |

## § 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2018年10月24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。

自2018年8月15日起，创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金正式变更为创金合信转债精选债券型证券投资基金，原创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金报告期自2018年7月01日起至2018年8月14日止，创金合信转债精选债券型证券投资基金报告期自2018年8月15日起至2018年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 转型后

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 创金合信转债精选债券   |
| 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    | 2018年08月15日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,176,752.36份  |
| 投资目标       | 在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转换债券为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。   |
| 投资策略       | 本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）进行分析，预测未来的利率趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极的投资策略，定期对 |

|                 |  |             |
|-----------------|--|-------------|
|                 | 投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数。                  |             |
| 业绩比较基准          | 中证可转换债券指数*90%+中证全债指数*10%                         |             |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，理论上其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，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           | 招商银行股份有限公司                                       |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信转债精选债券A                                      | 创金合信转债精选债券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 | 191,458.34份                                      | 985,294.02份 |

**转型前**

|             |   |            |
|-------------|---|------------|
| 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  | 1,186,981.67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      | 本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。   |            |
| 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 |

|                 |             |               |
|-----------------|-------------|---------------|
| 下属各类别基金的交易代码    | 002101      | 002102        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 177,260.50份 | 1,009,721.17份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2018年08月15日(基金合同生效日) - 2018年09月30日) |              |
|-----------------|---|--------------|
|                 | 创金合信转债精选债券A                             | 创金合信转债精选债券C  |
| 1. 本期已实现收益      | -346.17                                 | -2,299.68    |
| 2. 本期利润         | 3,150.41                                | 15,678.09    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0165                                  | 0.0159       |
| 4. 期末基金资产净值     | 195,213.06                              | 1,004,094.30 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0196                                  | 1.0191       |

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. 本基金转型日为2018年8月15日。

#### 3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2018年07月01日 - 2018年08月14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      | -403.91                        | -2,774.05  |
| 2. 本期利润         | 4,896.39                       | 25,392.52  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0278                         | 0.0251     |
| 4. 期末基金资产净值     | 189,274.34                     | 989,120.16 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0680                         | 0.9800     |

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(转型后)

#### 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

##### 创金合信转债精选债券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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.63%  | 0.30%     | 0.27%      | 0.30%         | 1.36% | 0.00% |

##### 创金合信转债精选债券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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.56%  | 0.30%     | 0.27%      | 0.30%         | 1.29% | 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：1、本基金于 2018 年 8 月 15 日由创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金转型而来。截至报告期末，本基金转型不满一年。

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（第十二部分二、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。

### 3.2 基金净值表现(转型前)

#### 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 | 2.69%  | 0.53%     | -1.00%     | 0.44%         | 3.69% | 0.09% |

##### 创金合信鑫优选混合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 | 2.62%  | 0.52%     | -1.00%     | 0.44%         | 3.62% | 0.08% |



### 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 |        |  |
| 张荣 | 本基金基金经理 | 2018-08-15  | -    | 8      | 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》的相关决定。

3、2018年8月15日创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金转型为创金合信转债精选债券型证券投资基金，基金经理由郑振源、张荣变更为张荣。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。本基金的投资范围、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

今年以来，中国经济面临内忧外患的局面，内忧方面是经济下行压力和去杠杆防风险政策压力并存，外患方面是中美贸易摩擦以及汇率波动。在此背景下，货币政策保持宽货币的整体基调，债券市场整体表现较好，利率债和高评级债券收益率显著下行，而信用利差尤其是中低评级信用利差扩大显著，股票市场表现较差，沪深300指数下跌14.69%。三季度以来，由于贸易摩擦

升级风险加剧和经济下行压力加大，政策开始转向托底，提出基建补短板和支持民企融资等措施，在政策托底的支撑下，股市跌幅放缓，同时出现结构分化，大盘股指数如上证50和沪深300出现底部企稳迹象，而中小板和创业板等小盘股指数依旧延续跌势，同时成交量急剧萎缩，市场悲观情绪浓重。转债市场同时受债券市场和股票市场两方面影响，上半年跌幅较大，三季度逐渐企稳，底部震荡。本组合主要投资于基本面良好、流动性较好的大盘蓝筹股转债标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年8月14日，创金合信鑫优选混合A基金份额净值为1.0680元；自2018年7月1日至2018年8月14日本基金份额净值增长率为6.80%，同期业绩比较基准收益率为0.97%。

截至2018年8月14日，创金合信鑫优选混合C基金份额净值为0.9800元；自2018年7月1日至2018年8月14日本基金份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为0.97%。

截至2018年9月30日，创金合信转债精选债券A基金份额净值为1.0196元；自2018年8月15日至2018年9月30日本基金份额净值增长率为1.63%，同期业绩比较基准收益率为0.27%。

截至2018年9月30日，创金合信转债精选债券C基金份额净值为1.0191元；自2018年8月15日至2018年9月30日本基金份额净值增长率为1.56%，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

本报告期内，本基金已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，该情形发生的时间范围为2018年8月15日起，并延续至报告期末。

### § 5 投资组合报告(转型后)

#### 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   | -            | -            |
|    | 其中：股票  | -            | -            |
| 2  | 基金投资   | -            | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 1,007,481.00 | 82.65        |
|    | 其中：债券  | 1,007,481.00 | 82.65        |
|    | 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      | 207,917.02   | 17.06  |
| 8 | 其他资产              | 3,561.14     | 0.29   |
| 9 | 合计                | 1,218,959.16 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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      | -            | -            |
|    | 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（可交换债） | 1,007,481.00 | 84.01        |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,007,481.00 | 84.01        |

## 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  | 113013 | XD国君转  | 1,100 | 115,060.00 | 9.59         |
| 2  | 110032 | 三一转债   | 900   | 114,237.00 | 9.53         |
| 3  | 132009 | 17中油EB | 1,100 | 113,850.00 | 9.49         |
| 4  | 128024 | 宁行转债   | 1,000 | 113,570.00 | 9.47         |
| 5  | 113018 | 常熟转债   | 1,000 | 112,920.00 | 9.42         |

#### 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 2017年12月29日，三一重工股份有限公司（以下简称“三一重工”）公告其公司副总裁谢志霞违规买卖公司股票情况，谢志霞于2017年8月30日至11月2日累计买入公司股票23600股，并于2017年11月10日全部卖出，其交易行为违反了《证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。三一重工已对谢志霞进行了严厉的批评教育并没收本次违规买卖股票所得收益人民币13659元，处以5000元人民币罚款。

本基金投研人员分析认为，高管违规减持股票事件并未对公司正常经营状况产生影响。三一重工作为工程机械行业龙头，受益于经济复苏，业绩增长较快，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三一重工进行了投资。

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   | 116.30   |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 3,084.87 |
| 5  | 应收申购款   | 359.97   |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 3,561.14 |

### 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 | 债券代码   | 债券名称   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|--------------|
| 1  | 113013 | XD国君转  | 115,060.00 | 9.59         |
| 2  | 110032 | 三一转债   | 114,237.00 | 9.53         |
| 3  | 132009 | 17中油EB | 113,850.00 | 9.49         |
| 4  | 128024 | 宁行转债   | 113,570.00 | 9.47         |
| 5  | 113018 | 常熟转债   | 112,920.00 | 9.42         |
| 6  | 113009 | 广汽转债   | 112,266.00 | 9.36         |
| 7  | 113011 | 光大转债   | 108,360.00 | 9.04         |
| 8  | 110034 | 九州转债   | 105,370.00 | 8.79         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 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 | -     | -            |

|   |                   |              |        |
|---|-------------------|--------------|--------|
|   | 其中：股票             | -            | -      |
| 2 | 基金投资              | -            | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 1,014,337.20 | 84.79  |
|   | 其中：债券             | 1,014,337.20 | 84.79  |
|   | 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      | 179,210.29   | 14.98  |
| 8 | 其他资产              | 2,806.95     | 0.23   |
| 9 | 合计                | 1,196,354.44 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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      | -            | -            |
|    | 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（可交换债） | 1,014,337.20 | 86.08        |

|    |      |              |       |
|----|------|--------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -            | -     |
| 9  | 其他   | -            | -     |
| 10 | 合计   | 1,014,337.20 | 86.08 |

### 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  | 113018 | 常熟转债   | 1,160 | 117,299.20 | 9.95         |
| 2  | 113011 | 光大转债   | 1,100 | 115,368.00 | 9.79         |
| 3  | 110032 | 三一转债   | 900   | 115,119.00 | 9.77         |
| 4  | 113013 | XD国君转  | 1,100 | 114,785.00 | 9.74         |
| 5  | 132013 | 17宝武EB | 1,100 | 114,235.00 | 9.69         |

**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 2017年12月29日，三一重工股份有限公司（以下简称“三一重工”）公告其公司副总裁谢志霞违规买卖公司股票情况，谢志霞于2017年8月30日至11月2日累计买入公司股票23600股，并于2017年11月10日全部卖出，其交易行为违反了《证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。三一重工已对谢志霞进行了严厉的批评教育并没收本次违规买卖股票所得收益人民币13659元，处以5000元人民币罚款。

本基金投研人员分析认为，高管违规减持股票事件并未对公司正常经营状况产生影响。三一重工作为工程机械行业龙头，受益于经济复苏，业绩增长较快，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三一重工进行了投资。

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   | 179.68   |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 2,627.27 |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 2,806.95 |

### 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 | 债券代码   | 债券名称   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|--------------|
| 1  | 113018 | 常熟转债   | 117,299.20 | 9.95         |
| 2  | 113011 | 光大转债   | 115,368.00 | 9.79         |
| 3  | 110032 | 三一转债   | 115,119.00 | 9.77         |
| 4  | 113013 | XD国君转  | 114,785.00 | 9.74         |
| 5  | 128024 | 宁行转债   | 112,410.00 | 9.54         |
| 6  | 113009 | 广汽转债   | 111,177.00 | 9.43         |
| 7  | 132009 | 17中油EB | 110,154.00 | 9.35         |
| 8  | 110034 | 九州转债   | 103,790.00 | 8.81         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

|  |            |            |
|--|------------|------------|
|  | 创金合信转债精选债券 | 创金合信转债精选债券 |
|--|------------|------------|

|                                    | A          | C            |
|------------------------------------|------------|--------------|
| 基金合同生效日的基金份额总额                     | 177,260.50 | 1,009,721.17 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 6,798.16   | 23,650.76    |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 4,042.89   | 24,483.98    |
| 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） | 11,442.57  | -23,593.93   |
| 报告期期末基金份额总额                        | 191,458.34 | 985,294.02   |

注：（1）创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金于2018年8月15日进行基金份额的折算，并将折算后的基金份额转换为创金合信转债精选债券型证券投资基金。

（2）用于计算折算比例的基金份额净值四舍五入保留到小数点后第9位，创金合信鑫优选混合经折算后的份额数四舍五入保留到小数点后两位，折算及转换结果请查阅基金的相关公告。

## § 6 开放式基金份额变动(转型前)

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               | 175,298.87 | 1,017,754.15 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 6,699.89   | 0.00         |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 4,738.26   | 8,032.98     |
| 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               | 177,260.50 | 1,009,721.17 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

### 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的情况。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

### 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              | 20180701 - 20180930    | 957,373.93 | 0.00 | 22,370.64 | 935,003.29 | 79.46% |
| 产品特有风险  |                |                        |            |      |           |            |        |
| <p>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：</p> <p>1、大额申购风险<br/>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。</p> <p>2、大额赎回风险<br/>(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；<br/>(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；<br/>(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；<br/>(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；<br/>(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。</p> <p>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。</p> |                |                        |            |      |           |            |        |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金于2018年7月6日至2018年8月3日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2018年8月6日表决通过了《关于创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，自该日起本次持有人大会决议生效。《创金合信转债精选债券型证券投资基金基金合同》、《创金合信转债精选债券型证券投资基金托管协议》自2018年8月15日起生效，原《创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《创金合信鑫优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同一起失效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信转债精选债券型证券投资基金基金合同》、《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、《创金合信转债精选债券型证券投资基金托管协议》、《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、创金合信转债精选债券型证券投资基金2018年第3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层

### 9.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2018年10月25日