

---

**创金合信国证 2000 指数发起式证券投资基金**

**2020 年第 1 季度报告**

**2020 年 03 月 31 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:2020 年 04 月 21 日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	7
§5 投资组合报告	7
5.1 报告期末基金资产组合情况	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	10
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	14
§9 影响投资者决策的其他重要信息	14
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	14
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	15
§10 备查文件目录	15
10.1 备查文件目录	15
10.2 存放地点	15
10.3 查阅方式	15

## § 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2020年04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2020年01月01日起至2020年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	创金合信国证2000指数	
基金主代码	005565	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
报告期末基金份额总额	11,258,318.46份	
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。	
业绩比较基准	国证2000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
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	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
下属分级基金的交易代码	005565	005566

报告期末下属分级基金的份额总额	5, 296, 269. 60份	5, 962, 048. 86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(2020年01月01日 - 2020年03月31日)	
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
1. 本期已实现收益	221, 135. 93	234, 284. 66
2. 本期利润	-3, 102. 76	-23, 940. 40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0006	-0. 0041
4. 期末基金资产净值	5, 071, 553. 79	5, 691, 482. 46
5. 期末基金份额净值	0. 9576	0. 9546

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

###### 创金合信国证2000指数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	-0. 32%	2. 17%	-1. 53%	2. 19%	1. 21%	-0. 02%

###### 创金合信国证2000指数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	-0. 38%	2. 17%	-1. 53%	2. 19%	1. 15%	-0. 02%

##### 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	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	12 年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UC LA）金融工程硕士。2006 年 7 月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013 年 2 月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，2016 年 3 月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部副总监、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》的相关规定。

#### 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《公开募集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

本基金跟踪的标的指数为国证2000指数，业绩基准为国证2000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。国证2000指数的样本股由：在深圳、上海证券交易所上市的除ST、\*ST股票外，按照市值和成交金额在市场中所占比例的综合排名，扣除国证1000指数样本股后，排名靠前的2000只股票构成。该指数于2014年3月28日发布，用以反映A股市场小盘股票的价格变动趋势。本基金的投资策略，正常情况下，主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证2000指数A基金份额净值为0.9576元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.32%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%；截至报告期末创金合信国证2000指数C基金份额净值为0.9546元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.38%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%。

#### 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	10,113,438.85	93.39
	其中：股票	10,113,438.85	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	231,725.00	2.14
	其中：债券	231,725.00	2.14
	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	460,051.98	4.25
8	其他资产	23,913.21	0.22
9	合计	10,829,129.04	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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	85,078.00	0.79
B	采矿业	123,803.00	1.15
C	制造业	6,769,349.83	62.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	271,530.00	2.52
E	建筑业	288,807.00	2.68
F	批发和零售业	594,808.60	5.53
G	交通运输、仓储和邮政业	225,579.00	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	802,486.82	7.46
J	金融业	41,280.00	0.38
K	房地产业	287,033.00	2.67
L	租赁和商务服务业	79,160.60	0.74
M	科学研究和技术服务业	187,068.00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	178,814.00	1.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,100.00	0.41
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	111,642.00	1.04



S	综合	22,899.00	0.21
	合计	10,113,438.85	93.96

### 5.2.2 报告期末（积极投资）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积极投资股票。

### 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

#### 5.3.1 报告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

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	002031	巨轮智能	35,700	67,830.00	0.63
2	603123	翠微股份	6,100	64,111.00	0.60
3	000913	钱江摩托	6,200	63,054.00	0.59
4	600693	东百集团	10,600	53,106.00	0.49
5	300497	富祥股份	1,900	51,452.00	0.48
6	300702	天宇股份	600	51,300.00	0.48
7	600382	广东明珠	8,400	51,072.00	0.47
8	000529	广弘控股	7,300	50,443.00	0.47
9	000042	中洲控股	5,500	50,435.00	0.47
10	002928	华夏航空	3,800	49,514.00	0.46

#### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	231,725.00	2.15
	其中：政策性金融债	231,725.00	2.15
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）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	231,725.00	2.15

### 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	018007	国开1801	2,300	231,725.00	2.15

### 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

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 2019年4月19日，深圳市中洲投资控股股份有限公司（以下简称中洲控股，代码000042）的股东方收到深圳证监局的《行政处罚决定书》，具体事项为：当事人黄光亮违反了《上市公司信息披露管理办法》第三十五条第三款“上市公司控股股东、实际控制人及其一致行动人应该及时、准确地告知上市公司……，并配合上市公司做好信息披露工作”的规定，构成《上市公司信息披露管理办法》第六十一条和《中华人民共和国证券法》第一百九十三条所述违法行为。对黄光亮责令改正，给与警告，并处以三十万元罚款。同时，根据《处罚决定书》，公司股东深圳市前海君至投资有限公司（以下简称“前海君至”）与公司第一大股东深圳市中洲置地有限公司（以下简称“中洲置地”）被认定为互为一致行动人关系，将导致本公司控股股东持股数量及持股比例将发生变化。

该公司另核实，本次控股股东及其一致行动人持股发生变动后不会导致公司股权分布不具备上市条件，不会导致公司控制权发生变化。

本基金投研人员分析认为，该公司对此股东违规受罚事件履行了法定披露义务、反应迅速，处理得当。违规责任主体是公司股东，违规事项对该公司经营业绩影响非常有限。当前该公司前景良好，经营稳健，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该公司进行了投资。

2019年8月28日，浙江天宇药业股份有限公司（证券代码：300702 下称：天宇股份）公告，称该公司高级管理人员违规减持公司股份。具体事项为，公司高级管理人员李美君女士因错误操作违规超额减持公司股票29,137股，超额减持成交金额 1,224,336.74 元，属于《深圳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》违规减持行为。该公司核实，截至2019年8月27日收盘时，李美君女士当前持有公司股份数量1,027,412股，占公司总股本的0.5638%，均为非限售流通股。李美君女士实施本次减持不会导致公司控制权发生变更，不会对公司的持续性经营产生影响。

违规事件发生后，责任人李美君深刻认识错误，并诚恳道歉。该公司在获知上述违规交易行为后，对李美君进行了严厉的批评教育，并要求公司所有持有5%以上股份的股东、董事、监事、高级管理人员再次认真学习《证券法》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《深圳证券交易所创业板上市公司规范运作指引》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》等相关法律法规、规范性文件，严格按照相关规定加强股票账户管理，审慎操作，防止此类事件再次发生。

本基金投研人员分析认为，该公司对此违规事件披露及时、反应迅速，处理得当。违规责任主体是公司管理人员个人，违规事项对该公司经营业绩影响非常有限。当前该公司前景良好，经营稳健，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该公司进行了投资。

2019年4月26日，江西富祥药业股份有限公司（证券代码300497，下称富祥股份）收到深圳证券交易所《关于对江西富祥药业股份有限公司的监管函》。具体事项为：2019年3月22日该公司收到持股5%以上股东浙江永太科技股份有限公司（以下简称“永太科技”）减持计划的通知，永太科技拟自当日起十五个交易日后的六个月内减持该公司股份数量不超过1,744.10万股，而该公司直到2019年3月26日晚间才披露上述减持计划的提示性公告。违反了《深圳证券交易所创业板股票上市规则（2018年11月修订）》第2.1、2.9和2.15条规定。

收到监管函后，该公司高度重视，立即整改：积极加强与重要股东间的沟通，强化内部管理，加强对信息披露规则的学习，提高信息披露质量，确保信息披露的真实、准确、完整、及时。

本基金投研人员分析认为，该公司对此违规信息披露事件深刻反省和及时整改，违规事项对该公司经营业绩影响非常有限。当前该公司前景良好，经营稳健，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该公司进行了投资。

2019年5月22日，广东明珠集团股份有限公司（证券简称：广东明珠， 证券代码：600382）及有关责任人（钟健如，时任广东明珠集团股份有限公司董事、董事会秘书兼财务总监；李杏，时任广东明珠集团股份有限公司董事兼董事会秘书）收到上海证券交易所的纪律处分决定书，被予以通报批评。

经查，广东明珠集团股份有限公司（以下简称广东明珠或公司）在审议程序和信息披露方面，有关责任人在职责履行方面存在以下违规情形。一是公司财务资助及关联交易达到股东大会审议标准，但未履行相应决策程序，信息披露不及时。二是公司重大合同执行进展及调整事项信息披露不及时。上海证券交易所经所纪律处分委员会审核通过，根据《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》等相关规定，作出如下纪律处分决定：对广东明珠集团股份有限公司，时任董事、董事会秘书兼财务总监钟健如，时任董事兼董事会秘书李杏予以通报批评。对于上述纪律处分，上海证券交易所将通报中国证监会，并记入上市公司诚信档案。公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定，规范运作，认真履行信息披露义务；董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。

本基金投研人员分析认为，在收到纪律处分决定书后，该公司及相关责任人改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。目前该公司估值处于历史底部，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该公司进行了投资。

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	677.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,460.88
5	应收申购款	17,775.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,913.21

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信国证2000指数 A	创金合信国证2000指数 C
报告期期初基金份额总额	5,424,427.08	5,743,286.37
报告期期间基金总申购份额	348,370.94	1,654,829.80
减：报告期期间基金总赎回份额	476,528.42	1,436,067.31
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	5,296,269.60	5,962,048.86

## § 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

	创金合信国证2000指 数A	创金合信国证2000指 数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,200.04	5,000,200.00
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	5,000,200.04	5,000,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	94.41	83.87

### 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	10,000,400.04	88.83%	10,000,400.04	88.83%	36月
基金管理人高级管理人员	5,586.65	0.05%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,005,986.69	88.88%	10,000,400.04	88.83%	36月

## § 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	20200101 - 20200331	10,000,400.04	0.00	0.00	10,000,400.04	88.83%
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 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 (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。</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>							

## 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、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2020年第1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](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

2020年04月21日