

创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年年度报告

2016年12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

送出日期：2017年03月27日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2016年01月01日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6 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	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	78
8.8 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贵金属投资明细	78
8.9 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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80

§10 开放式基金份额变动 .....	81
§11 重大事件揭示 .....	82
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	82
11.8 其他重大事件 .....	83
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	86
§13 备查文件目录 .....	86
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证500增强	
基金主代码	002311	
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	
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	
报告期末基金份额总额	183,356,133.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
下属分级基金的交易代码	002311	002316
报告期末下属分级基金的份 额总额	175,870,307.51份	7,485,825.56份

### 2.2 基金产品说明

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	中证500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。	
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95555
传真		0755-25832571	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518000	518040
法定代表人		刘学民	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.cjhxfund.com

基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼
------------	-----------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	创金合信中证500增强A	
	2016年	2015年12月31日-2015年12月31日
本期已实现收益	-443,392.77	200.00
本期利润	-2,090,291.02	200.00
加权平均基金份额本期利润	-0.2267	—
本期加权平均净值利润率	-25.04%	—
本期基金份额净值增长率	-7.27%	—
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-12,791,044.93	200.00
期末可供分配基金份额利润	—	—
期末基金资产净值	163,079,262.58	5,000,200.00
期末基金份额净值	0.9273	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	-7.27%	—

3.1.4 期间数据和指标	创金合信中证500增强C	
	2016年	2015年12月31日-2015年12月31日

本期已实现收益	-247,670.83	200.00
本期利润	-377,087.28	200.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0715	—
本期加权平均净值利润率	-8.06%	—
本期基金份额净值增长率	-7.32%	—
<b>3.1.5 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-548,327.55	200.00
期末可供分配基金份额利润	—	—
期末基金资产净值	6,937,498.01	5,000,200.00
期末基金份额净值	0.9268	1.0000
<b>3.1.6 累计期末指标</b>	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	-7.32%	—

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. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

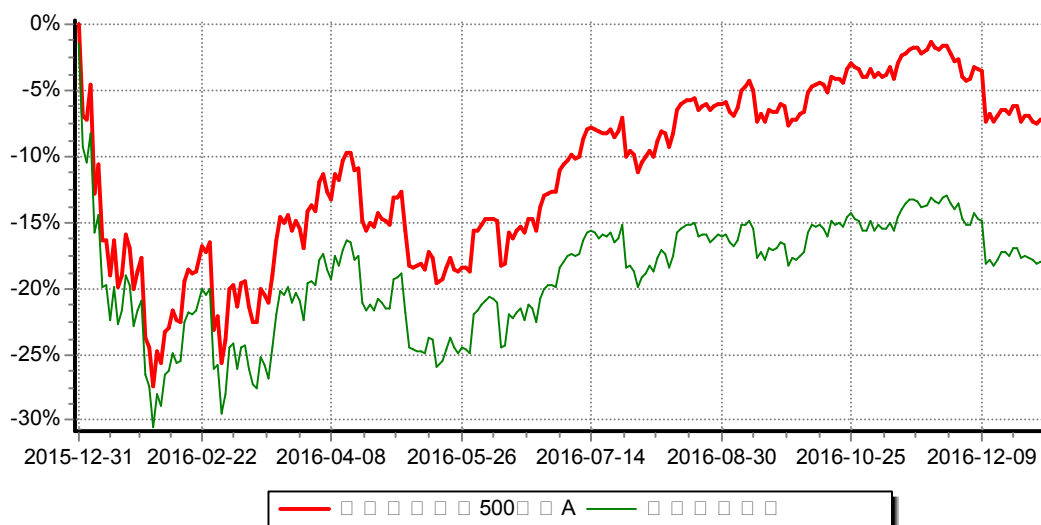
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

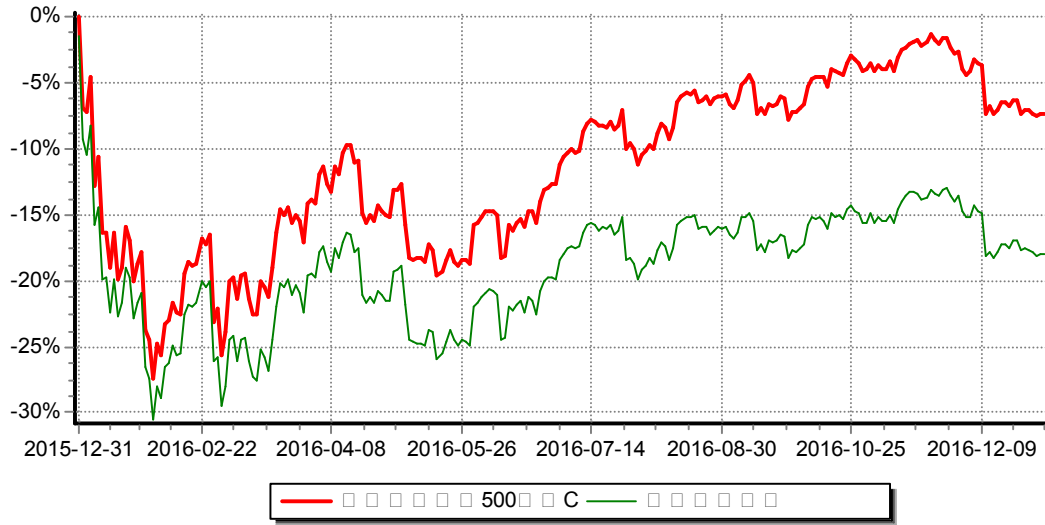
阶段 (创金合信中证500增强A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.74%	0.75%	-0.94%	0.78%	0.20%	-0.03%
过去六个月	6.16%	0.81%	2.24%	0.88%	3.92%	-0.07%
过去一年	-7.27%	1.79%	-16.72%	1.81%	9.45%	-0.02%
自基金合同生效日起至今(2015年12月31日-2016年12月31日)	-7.27%	1.78%	-17.98%	1.81%	10.71%	-0.03%



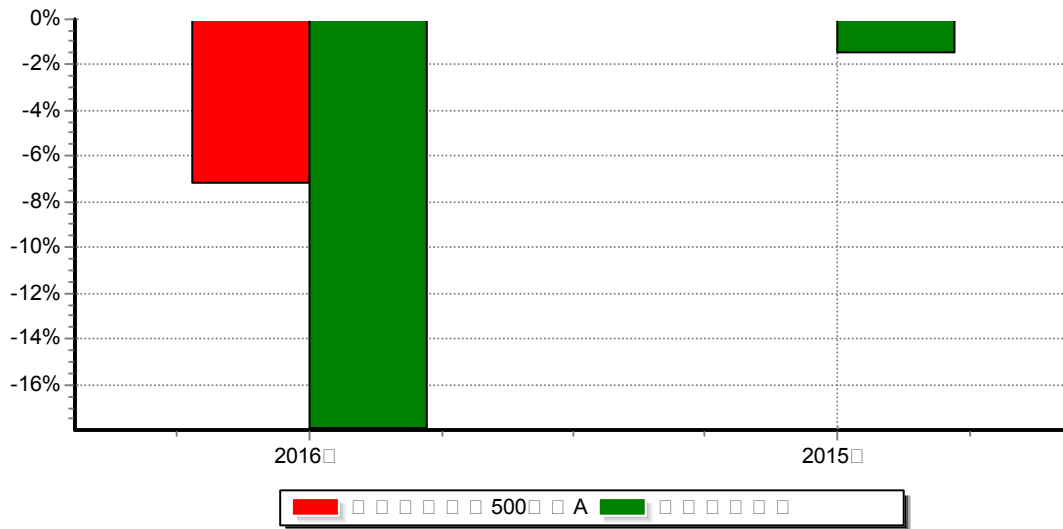
阶段 (创金合信中证500增强C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.72%	0.75%	-0.94%	0.78%	0.22%	-0.03%
过去六个月	6.16%	0.81%	2.24%	0.88%	3.92%	-0.07%
过去一年	-7.32%	1.79%	-16.72%	1.81%	9.40%	-0.02%
自基金合同生效日起至今(2015年12月31日-2016年12月31日)	-7.32%	1.78%	-17.98%	1.81%	10.66%	-0.03%

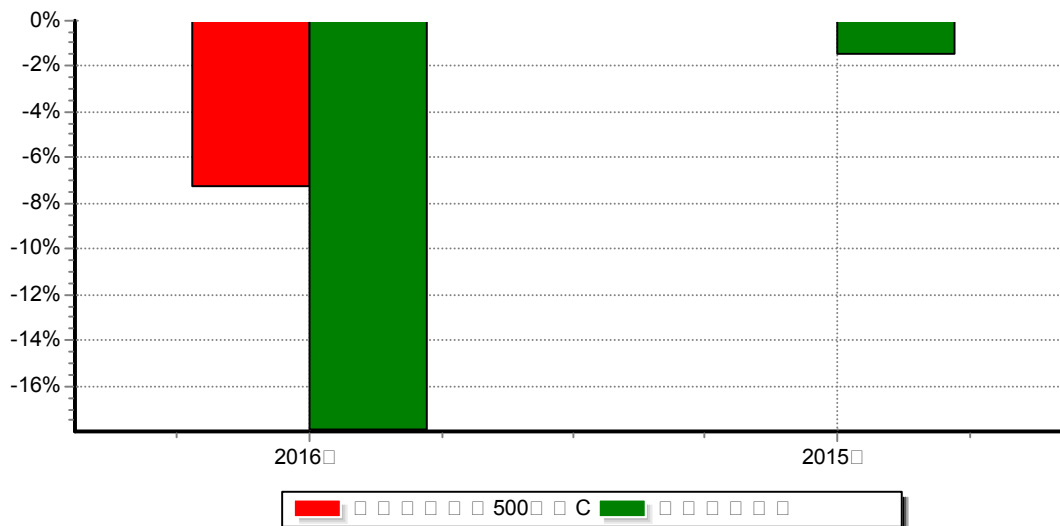
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015年12月31日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行17只公募基金。截至2016年12月31日，本公司共管理24只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品8只、股票型产品3只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约142.74亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程志田	基金经	2015年12月	—	10	程志田先生，中国国籍，

	理、量化投资部总监	31日			<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。</p> <p>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。</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、《创金合信中证500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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

##### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

##### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

##### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

##### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

#### 4.3.2 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。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差、反向交易进行了专项分析，未发现异常交易情况。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2016年，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持续稳健的Alpha；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。

#### 4.4.2 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-7.27%，C级净值增长率-7.32%，同期业绩比较基准收益率为-16.72%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去的半年里，PPI快速上行带动名义GDP增速上行，有望带动工业企业净利润增速提高；PPI上行对CPI的传导作用不明显，目前CPI水平较低，因为通胀引发货币政策收紧的可能性很小；经历了过去两年市场调整，当前股市估值略偏低，特别是大盘蓝筹股估值具备吸引力；增量资金进场意愿不明显，市场依然存在较多的结构性机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。修订完善《信息披露制度》等制度，建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估

值及净值计算的复核责任。

本基金管理人在风险控制办公会下设估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项要求。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人-招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息



财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第22095号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“创金合信中证500增强基金”）的财务报表，包括2016年12月31日及2015年12月31日的资产负债表、2016年度和2015年12月31日（基金合同生效日）至2015年12月31日的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是创金合信中证500增强基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导</p>

	<p>致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述创金合信中证500增强基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了2016年12月31日及2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	曹翠丽 边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2017-03-23

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,962,511.39	10,000,000.00
结算备付金		55,879.49	

存出保证金		2,546.16	—
交易性金融资产	7.4.7.2	161,224,599.97	—
其中：股票投资		161,224,599.97	—
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	10,781.53	400.00
应收股利		—	—
应收申购款		26,001.46	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		170,282,320.00	10,000,400.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		3,082.87	—
应付管理人报酬		34,603.84	—
应付托管费		4,325.50	—
应付销售服务费		459.04	—
应付交易费用	7.4.7.7	183,088.16	—
应交税费		—	—
应付利息		—	—

应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	40,000.00	—
负债合计		265,559.41	—
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	183,356,133.07	10,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-13,339,372.48	400.00
所有者权益合计		170,016,760.59	10,000,400.00
负债和所有者权益总计		170,282,320.00	10,000,400.00

注：1. 报告截止日2016年12月31日，基金份额总额183,356,133.07份，其中A类基金份额的份额总额为175,870,307.51份，份额净值0.9273元；C类基金份额的份额总额为7,485,825.56份，份额净值0.9268元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		-1,931,713.16	400.00
1. 利息收入		15,668.49	400.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,668.49	400.00
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填		-175,858.88	—

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-252,020.51	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收 益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	76,161.63	—
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,776,314.70	—
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.17	4,791.93	—
<b>减：二、费用</b>		535,665.14	—
1. 管理人报酬		100,694.56	—
2. 托管费		12,586.79	—
3. 销售服务费		4,662.51	—
4. 交易费用	7.4.7.18	346,146.38	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支 出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	71,574.90	—
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		-2,467,378.30	400.00
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“- ”号填列）</b>		-2,467,378.30	400.00

注：本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月31日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,000,000.00	400.00	10,000,400.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	2,467,378.30	-2,467,378.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	173,356,133.07	10,872,394.18	162,483,738.89
其中：1. 基金申购款	175,269,475.92	11,053,790.72	164,215,685.20
2. 基金赎回款	-1,913,342.85	181,396.54	-1,731,946.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	183,356,133.07	13,339,372.48	170,016,760.59
项 目	上年度可比期间2015年12月31日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,000,000.00	—	10,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	400.00	400.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	—	—	—

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	10,000,000.00	400.00	10,000,400.00

注：本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月31日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]3049号《关于准予创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第1505号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2015年12月31日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央

行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016年度和2015年12月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016年12月31日及2015年12月31日的财务状况以及 2016年度和2015年12月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金



融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的

部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计

未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4)同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	8,962,511.39	10,000,000.00
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	8,962,511.39	10,000,000.00

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		163,000,914.67	161,224,599.97	-1,776,314.70
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		163,000,914.67	161,224,599.97	-1,776,314.70
项目		上年度末2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		—	—	—

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末

本基金于本期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4. 2期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
应收活期存款利息	10,752.71	400.00
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	27.61	—
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	1.21	—
合计	10,781.53	400.00

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	183,088.16	—
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	183,088.16	—

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—

预提费用	40,000.00	—
合计	40,000.00	—

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	本期2016年01月01日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,000,000.00	5,000,000.00
本期申购	171,063,264.54	171,063,264.54
本期赎回(以“-”号填列)	-192,957.03	-192,957.03
本期末	175,870,307.51	175,870,307.51
项目 (创金合信中证500增强C)	基金份额(份)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,000,000.00	5,000,000.00
本期申购	4,206,211.38	4,206,211.38
本期赎回(以“-”号填列)	-1,720,385.82	-1,720,385.82
本期末	7,485,825.56	7,485,825.56

注：1. 申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

2. 本基金自2015年12月29日至2015年12月29日止期间公开发售，共募集有效净认购资金10,000,000.00元，其中A类基金募集有效净认购资金为5,000,000.00元，C类基金募集有效净认购资金为5,000,000.00元。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	200.00	—	200.00
本期利润	-443,392.77	-1,646,898.25	-2,090,291.02
本期基金份额交易产生的变动数	-8,738,446.88	-1,962,507.03	-10,700,953.91
其中：基金申购款	-8,761,306.61	-1,963,100.20	-10,724,406.81



基金赎回款	22,859.73	593.17	23,452.90
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-9,181,639.65	-3,609,405.28	-12,791,044.93

单位：人民币元

项目 (创金合信中证 500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	200.00	—	200.00
本期利润	-247,670.83	-129,416.45	-377,087.28
本期基金份额交易 产生的变动数	-147,086.03	-24,354.24	-171,440.27
其中：基金申购款	-321,241.01	-8,142.90	-329,383.91
基金赎回款	174,154.98	-16,211.34	157,943.64
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-394,556.86	-153,770.69	-548,327.55

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
活期存款利息收入	14,804.68	400.00
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	810.19	—
其他	53.62	—
合计	15,668.49	400.00

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年01月01日至2016年 12月31日	2015年12月31日至2015年 12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-252,020.51	—
股票投资收益——赎回差价 收入	—	—
股票投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	-252,020.51	—

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	62,827,417.68	—
减：卖出股票成本总额	63,079,438.19	—
买卖股票差价收入	-252,020.51	—

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	76,161.63	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	76,161.63	—

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-1,776,314.70	—
——股票投资	-1,776,314.70	—
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	-1,776,314.70	—

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
基金赎回费收入	4,791.93	—
合计	4,791.93	—

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	346,146.38	—

银行间市场交易费用	—	—
合计	346,146.38	—

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
审计费用	30,000.00	—
信息披露费	—	—
指数使用费	40,000.00	—
汇划手续费	1,574.90	—
合计	71,574.90	—

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。

对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

## 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年12月31日至2015年12月 31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
第一创业证券 股份有限公司	42,301,857.45	14.64%		—

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
第一创业证券 股份有限公司	30,523.71	11.85%		—

关联方名称	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	—	—	—	—

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	100,694.56	—
其中：支付销售机构的客户维护费	976.06	—

注：支付基金管理人 创金合信 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,586.79	—

注：支付基金托管人 招商银行股份有限公司 的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值× 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
创金合信	—	4,429.28	4,429.28
合计	—	4429.28	4429.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年12月31日至2015年12月31日		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
创金合信			
合计	—	—	—

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值× 0.1%/ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日		上年度可比期间 2015年12月31日至2015年 12月31日	
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
基金合同生效日持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00

期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.84%	66.79%	100.00%	100.00%

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年12月31日至2015年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	8,962,511.39	14,804.68	10,000,000.00	400.00

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券



本基金于本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600537	亿晶光电	2016-12-27	重大事项停牌	7.43	2017-01-13	8.17	166,900	1,194,427.45	1,240,067.00
002727	一心堂	2016-12-28	重大事项停牌	21.20	2017-01-05	21.66	9,000	191,968.00	190,800.00
002681	奋达科技	2016-12-19	重大事项停牌	12.93		—	8,100	109,946.12	104,733.00
000050	深天马A	2016-09-12	重大事项停牌	18.82	2017-03-23	20.70	5,100	97,978.91	95,982.00
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项停牌	16.42	2017-01-18	16.38	5,800	95,348.00	95,236.00
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项停牌	25.20		—	3,500	85,330.00	88,200.00
000560	昆百大A	2016-09-02	重大事项停牌	10.40		—	6,000	60,052.00	62,400.00
600090	同济堂	2016-12-26	重大事项停牌	11.75	2017-01-10	12.93	3,700	43,984.00	43,475.00
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项停牌	15.54	2017-01-03	15.89	1,800	28,689.16	27,972.00
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大事项停牌	25.94	2017-02-15	23.99	600	13,595.14	15,564.00

000748	长城信息(退市)	2016-11-01	重大事项停牌	20.31		—	600	12,504.00	12,186.00
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项停牌	15.80		—	700	8,855.50	11,060.00
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项停牌	13.79		—	770	10,367.40	10,618.30
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项停牌	7.29		—	1,400	9,163.73	10,206.00
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	2017-01-03	16.90	600	11,414.00	9,216.00
000697	炼石有色	2016-11-17	重大事项停牌	23.51		—	200	5,085.33	4,702.00
600151	航天机电	2016-11-11	重大事项停牌	10.97		—	400	4,482.50	4,388.00
600161	天坛生物	2016-12-06	重大事项停牌	39.40		—	100	3,680.50	3,940.00
000727	华东科技	2016-11-17	重大事项停牌	3.37	2017-02-15	3.47	700	2,363.10	2,359.00
000563	陕国投A	2016-10-14	重大事项停牌	7.48	2017-01-18	6.73	100	654.00	748.00

注：1. 本基金截至2016年12月31日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修

订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行A股股票，以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自2016年11月1日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于2017年1月18日上市流通，当日开盘单价为10.63元。长城信息人民币普通股股票自2017年1月18日起终止上市并摘牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

截至2016年12月31日，本基金未持有债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,962,511.39	—	—	—	8,962,511.39
结算备付金	55,879.49	—	—	—	55,879.49
存出保证金	2,546.16	—	—	—	2,546.16
交易性金融资产	—	—	—	161,224,599.97	161,224,599.97
应收利息	—	—	—	10,781.53	10,781.53
应收申购款	—	—	—	26,001.46	26,001.46
资产总计	9,020,937.04	—	—	161,261,382.96	170,282,320.00
负债					
应付赎回款	—	—	—	3,082.87	3,082.87
应付管理人报酬	—	—	—	34,603.84	34,603.84
应付托管费	—	—	—	4,325.50	4,325.50
应付销售服务费	—	—	—	459.04	459.04
应付交易费用	—	—	—	183,088.16	183,088.16
其他负债	—	—	—	40,000.00	40,000.00
负债总计	—	—	—	265,559.41	265,559.41
利率敏感度缺口	9,020,937.04	—	—	160,995,823.55	170,016,760.59
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2015年12月 31日					
资产					
银行存款	10,000,000 .00				10,000,000 .00
应收利息	—			400.00	400.00
资产总计	10,000,000 .00	—	—	400.00	10,000,400 .00
负债					
负债总计	—	—	—	—	—
利率敏感度缺 口	10,000,000 .00	—	—	400.00	10,000,400 .00

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投

资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例不低于90%。其中，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	161,224,599.97	94.83	—	—
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	161,224,599.97	94.83	—	—

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

	2016年12月31日	2015年12月31日
比较基准上涨5%资产净值变动	8,947,965.3	—
比较基准下降5%资产净值变动	-8,947,965.3	—

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为159,190,747.67元，属于第二层次的余额为2,033,852.30元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：无属于第一层次、第二层次及第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具



于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2015年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	161,224,599.97	94.68
	其中：股票	161,224,599.97	94.68
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	9,018,390.88	5.30
7	其他各项资产	39,329.15	0.02
8	合计	170,282,320.00	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----------

			例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,313,738.00	0.77
B	采矿业	2,749,063.00	1.62
C	制造业	77,169,419.85	45.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,033,946.00	2.96
E	建筑业	2,292,259.00	1.35
F	批发和零售业	11,354,981.00	6.68
G	交通运输、仓储和邮政业	2,962,817.00	1.74
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,106,726.00	5.36
J	金融业	346,655.00	0.20
K	房地产业	8,855,256.40	5.21
L	租赁和商务服务业	351,674.30	0.21
M	科学研究和技术服务业	1,111,877.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,888,392.00	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	222,035.00	0.13
Q	卫生和社会工作	64,000.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,818,080.00	1.66
S	综合	784,493.50	0.46
	合计	128,425,413.05	75.54

## 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	30,960.00	0.02
B	采矿业	1,611,077.00	0.95
C	制造业	20,525,539.92	12.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供	2,310,621.00	1.36

	应业		
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	869,996.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	69,954.00	0.04
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,857,730.00	1.09
J	金融业	38,039.00	0.02
K	房地产业	3,325,358.00	1.96
L	租赁和商务服务业	1,711,282.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	448,630.00	0.26
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	32,799,186.92	19.29

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002581	未名医药	76,300	1,851,801.00	1.09
2	601012	隆基股份	130,500	1,747,395.00	1.03
3	600094	大名城	191,500	1,704,350.00	1.00
4	600736	苏州高新	187,700	1,694,931.00	1.00
5	600312	平高电气	107,500	1,679,150.00	0.99
6	600664	哈药股份	194,700	1,670,526.00	0.98
7	600335	国机汽车	136,000	1,652,400.00	0.97

8	601231	环旭电子	152,600	1,634,346.00	0.96
9	603568	伟明环保	70,100	1,633,330.00	0.96
10	000810	创维数字	115,000	1,618,050.00	0.95
11	600216	浙江医药	125,800	1,595,144.00	0.94
12	000681	视觉中国	81,900	1,561,014.00	0.92
13	000999	华润三九	62,600	1,548,098.00	0.91
14	000636	风华高科	157,100	1,533,296.00	0.90
15	002309	中利科技	107,600	1,528,996.00	0.90
16	600981	汇鸿集团	173,900	1,476,411.00	0.87
17	600978	宜华生活	137,100	1,460,115.00	0.86
18	000581	威孚高科	64,500	1,447,380.00	0.85
19	002221	东华能源	116,000	1,437,240.00	0.85
20	600240	华业资本	133,010	1,428,527.40	0.84
21	600872	中炬高新	99,900	1,406,592.00	0.83
22	300287	飞利信	117,100	1,393,490.00	0.82
23	603567	珍宝岛	70,000	1,383,200.00	0.81
24	600970	中材国际	194,800	1,381,132.00	0.81
25	300202	聚龙股份	55,900	1,375,140.00	0.81
26	000598	兴蓉环境	236,800	1,363,968.00	0.80
27	002118	紫鑫药业	189,200	1,362,240.00	0.80
28	002463	沪电股份	283,400	1,354,652.00	0.80
29	600862	中航高科	110,500	1,352,520.00	0.80
30	002051	中工国际	58,300	1,336,236.00	0.79
31	000825	太钢不锈	335,800	1,323,052.00	0.78
32	600694	大商股份	32,900	1,313,697.00	0.77
33	600750	江中药业	42,200	1,300,604.00	0.76
34	600826	兰生股份	47,400	1,294,968.00	0.76
35	600366	宁波韵升	65,600	1,291,664.00	0.76
36	600850	华东电脑	53,200	1,286,376.00	0.76
37	001696	宗申动力	136,800	1,285,920.00	0.76
38	603328	依顿电子	40,200	1,285,596.00	0.76

39	300043	星辉娱乐	126,400	1,281,696.00	0.75
40	002238	天威视讯	86,600	1,268,690.00	0.75
41	000631	顺发恒业	258,400	1,266,160.00	0.74
42	600586	金晶科技	270,700	1,253,341.00	0.74
43	600537	亿晶光电	166,900	1,240,067.00	0.73
44	300297	蓝盾股份	98,300	1,222,852.00	0.72
45	002414	高德红外	53,400	1,216,452.00	0.72
46	600751	天海投资	143,800	1,202,168.00	0.71
47	600180	瑞茂通	87,800	1,188,812.00	0.70
48	002233	塔牌集团	125,200	1,170,620.00	0.69
49	600825	新华传媒	134,400	1,167,936.00	0.69
50	000969	安泰科技	109,900	1,158,346.00	0.68
51	600597	光明乳业	88,400	1,154,504.00	0.68
52	603698	航天工程	40,300	1,111,877.00	0.65
53	000552	靖远煤电	286,100	1,084,319.00	0.64
54	600874	创业环保	130,400	1,060,152.00	0.62
55	600458	时代新材	74,200	1,049,930.00	0.62
56	000973	佛塑科技	136,800	1,026,000.00	0.60
57	600026	中远海能	148,500	1,011,285.00	0.59
58	000959	首钢股份	150,800	998,296.00	0.59
59	600917	重庆燃气	74,500	982,655.00	0.58
60	002477	雏鹰农牧	195,700	982,414.00	0.58
61	002551	尚荣医疗	48,300	961,653.00	0.57
62	002410	广联达	63,600	928,560.00	0.55
63	002482	广田集团	91,700	848,225.00	0.50
64	002392	北京利尔	142,700	821,952.00	0.48
65	601929	吉视传媒	191,200	801,128.00	0.47
66	002106	莱宝高科	70,200	789,048.00	0.46
67	000762	西藏矿业	43,800	745,914.00	0.44
68	002572	索菲亚	13,700	741,992.00	0.44
69	002179	中航光电	19,500	707,655.00	0.42

70	002422	科伦药业	42,300	681,876.00	0.40
71	600079	人福医药	32,100	640,395.00	0.38
72	603883	老百姓	13,700	639,105.00	0.38
73	002092	中泰化学	50,800	614,680.00	0.36
74	600755	厦门国贸	71,000	582,200.00	0.34
75	002437	誉衡药业	69,275	572,904.25	0.34
76	600864	哈投股份	48,800	557,296.00	0.33
77	000028	国药一致	8,300	555,270.00	0.33
78	002407	多氟多	19,300	526,697.00	0.31
79	000723	美锦能源	34,500	521,640.00	0.31
80	002249	大洋电机	60,200	519,526.00	0.31
81	002004	华邦健康	56,200	509,734.00	0.30
82	600823	世茂股份	72,400	508,248.00	0.30
83	600270	外运发展	30,700	507,778.00	0.30
84	002050	三花智控	44,000	485,760.00	0.29
85	300324	旋极信息	25,000	483,250.00	0.28
86	600183	生益科技	42,300	465,300.00	0.27
87	600175	美都能源	92,200	456,390.00	0.27
88	603806	福斯特	9,800	453,446.00	0.27
89	603866	桃李面包	10,300	452,170.00	0.27
90	600522	中天科技	42,500	447,525.00	0.26
91	002460	赣锋锂业	16,800	445,368.00	0.26
92	000587	金洲慈航	29,700	441,936.00	0.26
93	000021	深科技	44,700	421,521.00	0.25
94	000620	新华联	49,200	417,216.00	0.25
95	600483	福能股份	37,400	414,018.00	0.24
96	600267	海正药业	30,500	401,075.00	0.24
97	002019	亿帆医药	26,100	399,069.00	0.23
98	002701	奥瑞金	45,460	392,774.40	0.23
99	600418	江淮汽车	33,700	389,572.00	0.23
100	600801	华新水泥	50,100	388,275.00	0.23

101	000703	恒逸石化	24,900	374,247.00	0.22
102	603868	飞科电器	7,900	370,194.00	0.22
103	600600	青岛啤酒	12,500	368,000.00	0.22
104	300199	翰宇药业	20,200	363,196.00	0.21
105	600338	西藏珠峰	12,000	347,760.00	0.20
106	002271	东方雨虹	15,500	336,195.00	0.20
107	600298	安琪酵母	18,300	326,106.00	0.19
108	600138	中青旅	15,300	320,841.00	0.19
109	002285	世联行	41,100	312,360.00	0.18
110	600487	亨通光电	16,200	302,292.00	0.18
111	002266	浙富控股	51,900	298,944.00	0.18
112	600776	东方通信	34,800	297,888.00	0.18
113	300113	顺网科技	11,000	295,790.00	0.17
114	600557	康缘药业	17,300	292,889.00	0.17
115	600748	上实发展	34,100	279,279.00	0.16
116	600770	综艺股份	26,850	277,897.50	0.16
117	000656	金科股份	52,300	274,052.00	0.16
118	002595	豪迈科技	12,800	269,440.00	0.16
119	002573	清新环境	14,600	255,062.00	0.15
120	002589	瑞康医药	7,700	249,865.00	0.15
121	000543	皖能电力	32,600	248,086.00	0.15
122	600517	置信电气	25,400	247,142.00	0.15
123	603188	亚邦股份	13,800	246,468.00	0.14
124	300166	东方国信	11,600	241,164.00	0.14
125	600894	广日股份	17,500	239,225.00	0.14
126	000528	柳工	32,100	234,651.00	0.14
127	600201	生物股份	7,400	233,766.00	0.14
128	600584	长电科技	13,000	229,450.00	0.13
129	000426	兴业矿业	25,700	224,104.00	0.13
130	603377	东方时尚	5,500	222,035.00	0.13
131	601689	拓普集团	7,500	220,650.00	0.13

132	300026	红日药业	40,400	219,372.00	0.13
133	600198	大唐电信	13,700	217,419.00	0.13
134	300136	信维通信	7,600	216,600.00	0.13
135	000761	本钢板材	40,000	215,200.00	0.13
136	600643	爱建集团	16,900	209,729.00	0.12
137	600503	华丽家族	25,200	208,908.00	0.12
138	300253	卫宁健康	10,500	205,695.00	0.12
139	300156	神雾环保	8,200	205,082.00	0.12
140	002317	众生药业	16,500	203,775.00	0.12
141	002416	爱施德	13,400	197,382.00	0.12
142	600219	南山铝业	63,100	194,979.00	0.11
143	300274	阳光电源	18,180	191,617.20	0.11
144	002727	一心堂	9,000	190,800.00	0.11
145	600158	中体产业	8,000	188,560.00	0.11
146	002640	跨境通	10,100	184,830.00	0.11
147	600635	大众公用	30,700	184,507.00	0.11
148	002327	富安娜	20,900	183,920.00	0.11
149	002665	首航节能	20,640	180,806.40	0.11
150	300032	金龙机电	11,200	180,208.00	0.11
151	600410	华胜天成	16,300	177,181.00	0.10
152	002223	鱼跃医疗	5,700	176,814.00	0.10
153	600835	上海机电	8,900	173,728.00	0.10
154	002371	七星电子	6,500	172,900.00	0.10
155	000786	北新建材	16,800	172,872.00	0.10
156	600516	方大炭素	18,500	171,310.00	0.10
157	300115	长盈精密	6,520	169,911.20	0.10
158	000661	长春高新	1,500	167,775.00	0.10
159	002405	四维图新	8,600	166,410.00	0.10
160	600220	江苏阳光	37,700	163,618.00	0.10
161	000667	美好置业	44,100	162,729.00	0.10
162	603198	迎驾贡酒	7,500	161,625.00	0.10



163	002048	宁波华翔	7,300	161,622.00	0.10
164	002505	大康农业	45,500	161,070.00	0.09
165	600195	中牧股份	7,500	159,375.00	0.09
166	000960	锡业股份	12,100	158,752.00	0.09
167	002217	合力泰	8,600	153,940.00	0.09
168	002261	拓维信息	12,700	151,384.00	0.09
169	600699	均胜电子	4,500	148,905.00	0.09
170	300266	兴源环境	2,700	148,176.00	0.09
171	600176	中国巨石	15,000	147,600.00	0.09
172	600166	福田汽车	44,900	138,741.00	0.08
173	600549	厦门钨业	6,300	138,726.00	0.08
174	600851	海欣股份	10,700	138,351.00	0.08
175	600315	上海家化	5,100	138,261.00	0.08
176	300296	利亚德	4,100	138,252.00	0.08
177	000930	中粮生化	10,200	137,088.00	0.08
178	600291	西水股份	7,100	136,178.00	0.08
179	002277	友阿股份	9,400	134,984.00	0.08
180	000998	隆平高科	6,200	132,866.00	0.08
181	600143	金发科技	16,800	130,704.00	0.08
182	600436	片仔癀	2,800	128,212.00	0.08
183	600521	华海药业	5,780	127,333.40	0.07
184	600289	亿阳信通	9,800	126,910.00	0.07
185	002366	台海核电	2,300	123,326.00	0.07
186	600435	北方导航	9,400	122,576.00	0.07
187	000418	小天鹅A	3,600	116,352.00	0.07
188	000158	常山股份	9,300	116,250.00	0.07
189	600062	华润双鹤	5,200	115,596.00	0.07
190	600277	亿利洁能	16,200	115,182.00	0.07
191	000970	中科三环	8,600	114,810.00	0.07
192	002508	老板电器	3,100	114,080.00	0.07
193	000997	新大陆	5,800	112,694.00	0.07

194	002340	格林美	17,200	112,660.00	0.07
195	600879	航天电子	7,300	111,252.00	0.07
196	002168	深圳惠程	6,900	109,434.00	0.06
197	002308	威创股份	7,400	109,076.00	0.06
198	600614	鹏起科技	9,300	108,810.00	0.06
199	000566	海南海药	8,300	105,493.00	0.06
200	002681	奋达科技	8,100	104,733.00	0.06
201	600266	北京城建	7,600	101,308.00	0.06
202	000690	宝新能源	10,900	101,043.00	0.06
203	002690	美亚光电	4,700	99,452.00	0.06
204	002176	江特电机	8,300	99,019.00	0.06
205	600056	中国医药	5,100	97,053.00	0.06
206	002013	中航机电	5,300	96,937.00	0.06
207	000050	深天马A	5,100	95,982.00	0.06
208	600120	浙江东方	3,300	95,436.00	0.06
209	600687	刚泰控股	5,800	95,236.00	0.06
210	000089	深圳机场	11,700	93,600.00	0.06
211	002439	启明星辰	4,400	91,476.00	0.05
212	600497	驰宏锌锗	12,800	89,984.00	0.05
213	600500	中化国际	7,700	89,782.00	0.05
214	002025	航天电器	3,500	88,200.00	0.05
215	002161	远望谷	7,500	86,475.00	0.05
216	600759	洲际油气	8,800	86,416.00	0.05
217	002311	海大集团	5,700	85,785.00	0.05
218	600426	华鲁恒升	6,260	82,945.00	0.05
219	300159	新研股份	5,900	80,122.00	0.05
220	002030	达安基因	3,400	78,880.00	0.05
221	002498	汉缆股份	17,700	76,110.00	0.04
222	600633	浙报传媒	4,200	74,172.00	0.04
223	000939	凯迪生态	5,700	73,359.00	0.04
224	000400	许继电气	3,900	70,785.00	0.04

225	600594	益佰制药	4,200	69,930.00	0.04
226	002056	横店东磁	4,900	68,159.00	0.04
227	601233	桐昆股份	4,500	64,620.00	0.04
228	002038	双鹭药业	2,400	64,104.00	0.04
229	300244	迪安诊断	2,000	64,000.00	0.04
230	000758	中色股份	7,900	63,121.00	0.04
231	600565	迪马股份	8,400	62,328.00	0.04
232	600388	龙净环保	5,000	61,850.00	0.04
233	002698	博实股份	3,800	59,166.00	0.03
234	000572	海马汽车	11,000	58,960.00	0.03
235	601002	晋亿实业	6,100	58,072.00	0.03
236	300010	立思辰	3,400	56,508.00	0.03
237	000806	银河生物	3,500	55,440.00	0.03
238	002353	杰瑞股份	2,700	54,810.00	0.03
239	600811	东方集团	7,300	52,195.00	0.03
240	000078	海王生物	8,100	51,030.00	0.03
241	600200	江苏吴中	2,600	50,206.00	0.03
242	000012	南玻A	4,400	49,896.00	0.03
243	002273	水晶光电	2,500	49,750.00	0.03
244	000031	中粮地产	5,500	49,060.00	0.03
245	600787	中储股份	5,400	48,978.00	0.03
246	600601	方正科技	10,600	48,760.00	0.03
247	000878	云南铜业	4,100	48,421.00	0.03
248	000988	华工科技	3,000	46,950.00	0.03
249	600528	中铁二局	3,400	46,784.00	0.03
250	000488	晨鸣纸业	4,500	46,620.00	0.03
251	600466	蓝光发展	4,600	44,482.00	0.03
252	601699	潞安环能	5,500	44,275.00	0.03
253	300134	大富科技	1,700	43,112.00	0.03
254	002408	齐翔腾达	3,900	42,900.00	0.03
255	002018	华信国际	4,000	40,680.00	0.02

256	600881	亚泰集团	7,400	40,478.00	0.02
257	000652	泰达股份	7,300	40,296.00	0.02
258	002093	国脉科技	3,600	39,852.00	0.02
259	300055	万邦达	2,400	39,312.00	0.02
260	002250	联化科技	2,400	38,832.00	0.02
261	600478	科力远	3,800	38,000.00	0.02
262	603589	口子窖	1,100	35,343.00	0.02
263	000979	中弘股份	13,200	34,848.00	0.02
264	000541	佛山照明	3,500	34,440.00	0.02
265	002544	杰赛科技	1,200	33,768.00	0.02
266	002155	湖南黄金	2,800	32,060.00	0.02
267	002191	劲嘉股份	3,000	31,230.00	0.02
268	000006	深振业A	3,300	31,185.00	0.02
269	601000	唐山港	7,400	29,674.00	0.02
270	600108	亚盛集团	5,000	28,600.00	0.02
271	002491	通鼎互联	1,800	27,972.00	0.02
272	002244	滨江集团	3,700	25,826.00	0.02
273	600064	南京高科	1,500	25,125.00	0.01
274	600572	康恩贝	3,400	24,854.00	0.01
275	600098	广州发展	2,200	24,684.00	0.01
276	600499	科达洁能	3,200	24,192.00	0.01
277	601880	大连港	8,300	23,240.00	0.01
278	600575	皖江物流	4,000	23,000.00	0.01
279	603766	隆鑫通用	1,100	22,858.00	0.01
280	002399	海普瑞	1,200	21,864.00	0.01
281	600325	华发股份	1,700	21,760.00	0.01
282	600863	内蒙华电	6,800	20,944.00	0.01
283	002707	众信旅游	1,300	20,215.00	0.01
284	600717	天津港	1,900	19,152.00	0.01
285	002078	太阳纸业	2,800	18,704.00	0.01
286	600307	酒钢宏兴	6,800	18,564.00	0.01

287	600511	国药股份	600	18,060.00	0.01
288	002672	东江环保	1,000	17,600.00	0.01
289	002657	中科金财	400	17,264.00	0.01
290	002444	巨星科技	1,100	17,160.00	0.01
291	603019	中科曙光	600	16,692.00	0.01
292	600967	北方创业	1,200	16,284.00	0.01
293	600808	马钢股份	5,700	16,131.00	0.01
294	000975	银泰资源	1,000	15,640.00	0.01
295	600757	长江传媒	1,800	14,958.00	0.01
296	600160	巨化股份	1,400	14,812.00	0.01
297	000926	福星股份	1,100	14,014.00	0.01
298	600022	山东钢铁	5,400	13,500.00	0.01
299	600416	湘电股份	900	13,239.00	0.01
300	000860	顺鑫农业	600	13,200.00	0.01
301	601678	滨化股份	1,800	13,122.00	0.01
302	002375	亚厦股份	1,200	12,696.00	0.01
303	000748	长城信息	600	12,186.00	0.01
304	300088	长信科技	700	11,060.00	0.01
305	600348	阳泉煤业	1,600	10,768.00	0.01
306	002400	省广股份	770	10,618.30	0.01
307	002276	万马股份	700	10,521.00	0.01
308	600673	东阳光科	1,400	10,206.00	0.01
309	002022	科华生物	500	10,000.00	0.01
310	002390	信邦制药	1,000	9,890.00	0.01
311	000547	航天发展	600	9,216.00	0.01
312	600039	四川路桥	1,900	9,006.00	0.01
313	000592	平潭发展	1,300	8,788.00	0.01
314	000066	长城电脑	700	8,708.00	0.01
315	600300	维维股份	1,300	8,684.00	0.01
316	002281	光迅科技	100	7,850.00	—
317	600409	三友化工	800	7,512.00	—

318	002268	卫士通	200	6,284.00	—
319	000612	焦作万方	500	5,775.00	—
320	000697	炼石有色	200	4,702.00	—
321	600151	航天机电	400	4,388.00	—
322	600611	大众交通	600	3,942.00	—
323	600161	天坛生物	100	3,940.00	—
324	300273	和佳股份	200	3,412.00	—
325	600187	国中水务	600	3,234.00	—
326	600380	健康元	300	2,979.00	—
327	600884	杉杉股份	200	2,816.00	—
328	600587	新华医疗	100	2,511.00	—
329	000727	华东科技	700	2,359.00	—
330	600869	智慧能源	300	2,322.00	—
331	600316	洪都航空	100	1,966.00	—
332	300122	智飞生物	100	1,647.00	—
333	600392	盛和资源	100	1,333.00	—
334	002489	浙江永强	100	757.00	—
335	000563	陕国投A	100	748.00	—

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000662	天夏智慧	58,400	1,243,336.00	0.73
2	600162	香江控股	298,000	1,183,060.00	0.70
3	000910	大亚圣象	53,400	1,019,940.00	0.60
4	000030	富奥股份	113,500	964,750.00	0.57
5	600093	禾嘉股份	62,800	910,600.00	0.54
6	601137	博威合金	66,700	871,769.00	0.51
7	300407	凯发电气	47,800	864,702.00	0.51
8	002563	森马服饰	83,600	858,572.00	0.50
9	601677	明泰铝业	57,800	855,440.00	0.50

10	002534	杭锅股份	72,075	804,357.00	0.47
11	600683	京投发展	89,700	793,845.00	0.47
12	600984	建设机械	90,200	788,348.00	0.46
13	300158	振东制药	40,200	787,116.00	0.46
14	002246	北化股份	62,400	745,056.00	0.44
15	601339	百隆东方	118,200	737,568.00	0.43
16	002680	长生生物	42,400	733,520.00	0.43
17	600405	动力源	64,300	718,231.00	0.42
18	600891	秋林集团	77,000	717,640.00	0.42
19	600602	云赛智联	74,600	710,938.00	0.42
20	601898	中煤能源	118,300	687,323.00	0.40
21	002182	云海金属	34,500	642,045.00	0.38
22	600644	乐山电力	69,800	639,368.00	0.38
23	000863	三湘印象	74,700	634,203.00	0.37
24	601139	深圳燃气	65,300	593,577.00	0.35
25	600028	中国石化	106,200	574,542.00	0.34
26	300067	安诺其	65,500	563,300.00	0.33
27	000880	潍柴重机	39,200	549,192.00	0.32
28	300050	世纪鼎利	37,300	489,003.00	0.29
29	300265	通光线缆	32,400	477,900.00	0.28
30	002014	永新股份	29,300	468,800.00	0.28
31	300138	晨光生物	24,800	452,104.00	0.27
32	603018	中设集团	13,000	448,630.00	0.26
33	300023	宝德股份	23,500	442,505.00	0.26
34	600233	圆通速递	15,500	395,095.00	0.23
35	600515	海航基础	33,100	383,960.00	0.23
36	000421	南京公用	40,400	359,156.00	0.21
37	002027	分众传媒	25,100	358,177.00	0.21
38	600362	江西铜业	21,000	351,330.00	0.21
39	000040	东旭蓝天	26,300	323,227.00	0.19
40	002615	哈尔斯	18,100	317,655.00	0.19

41	300116	坚瑞沃能	16,800	304,080.00	0.18
42	601989	中国重工	40,000	283,600.00	0.17
43	000034	神州数码	12,300	274,536.00	0.16
44	002612	朗姿股份	14,300	259,116.00	0.15
45	002624	完美世界	8,300	247,257.00	0.15
46	000813	德展健康	16,800	242,424.00	0.14
47	000591	太阳能	17,700	240,012.00	0.14
48	002654	万润科技	18,800	207,552.00	0.12
49	300048	合康新能	24,600	202,212.00	0.12
50	600236	桂冠电力	31,900	194,590.00	0.11
51	002600	江粉磁材	18,700	191,488.00	0.11
52	600105	永鼎股份	17,700	182,841.00	0.11
53	000002	万科A	8,300	170,565.00	0.10
54	000601	韶能股份	18,000	154,620.00	0.09
55	000070	特发信息	5,900	149,211.00	0.09
56	300114	中航电测	5,900	134,402.00	0.08
57	002206	海利得	7,000	133,980.00	0.08
58	002203	海亮股份	16,500	132,990.00	0.08
59	002555	三七互娱	7,700	126,280.00	0.07
60	002171	楚江新材	7,900	125,215.00	0.07
61	002517	恺英网络	3,700	124,172.00	0.07
62	002100	天康生物	13,700	122,889.00	0.07
63	300394	天孚通信	3,600	116,532.00	0.07
64	000971	高升控股	4,900	115,885.00	0.07
65	603566	普莱柯	4,600	111,228.00	0.07
66	000989	九芝堂	5,000	108,550.00	0.06
67	601088	中国神华	6,600	106,788.00	0.06
68	600828	茂业商业	12,500	105,625.00	0.06
69	000544	中原环保	5,700	99,066.00	0.06
70	600606	绿地控股	11,300	98,423.00	0.06
71	002637	赞宇科技	6,100	85,705.00	0.05



72	300252	金信诺	2,700	80,217.00	0.05
73	000560	昆百大A	6,000	62,400.00	0.04
74	600075	新疆天业	4,600	57,224.00	0.03
75	600208	新湖中宝	13,700	56,992.00	0.03
76	300306	远方光电	2,400	56,760.00	0.03
77	000429	粤高速A	7,700	52,668.00	0.03
78	300456	耐威科技	1,000	50,930.00	0.03
79	600498	烽火通信	2,000	50,420.00	0.03
80	600345	长江通信	2,100	47,712.00	0.03
81	002103	广博股份	2,700	46,791.00	0.03
82	300429	强力新材	1,400	44,800.00	0.03
83	600090	同济堂	3,700	43,475.00	0.03
84	000550	江铃汽车	1,500	40,500.00	0.02
85	002270	华明装备	2,800	40,152.00	0.02
86	002305	南国置业	7,100	36,849.00	0.02
87	300299	富春通信	1,700	34,459.00	0.02
88	600812	华北制药	5,300	33,178.00	0.02
89	300529	健帆生物	700	32,942.00	0.02
90	002458	益生股份	900	30,960.00	0.02
91	601229	上海银行	1,300	30,264.00	0.02
92	002314	南山控股	3,700	28,194.00	0.02
93	000893	东凌国际	2,400	27,816.00	0.02
94	002636	金安国纪	1,600	26,160.00	0.02
95	300233	金城医药	900	21,933.00	0.01
96	600323	瀚蓝环境	1,400	20,104.00	0.01
97	000887	中鼎股份	600	15,564.00	0.01
98	002303	美盈森	1,500	15,420.00	0.01
99	600548	深高速	1,500	12,750.00	0.01
100	002218	拓日新能	1,300	11,687.00	0.01
101	300396	迪瑞医疗	300	11,349.00	0.01
102	600900	长江电力	800	10,128.00	0.01

103	300310	宜通世纪	400	9,736.00	0.01
104	600261	阳光照明	1,200	8,664.00	0.01
105	002173	*ST创疗	400	8,020.00	0.00
106	002736	国信证券	500	7,775.00	0.00
107	600285	羚锐制药	500	6,380.00	0.00
108	002631	德尔未来	300	5,571.00	0.00
109	600350	山东高速	700	4,536.00	0.00
110	603818	曲美家居	200	3,490.00	0.00
111	000063	中兴通讯	100	1,595.00	0.00
112	002032	苏泊尔	26	907.92	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600664	哈药股份	2,014,517.64	20.14
2	601012	隆基股份	1,965,372.00	19.65
3	600335	国机汽车	1,858,935.92	18.59
4	002581	未名医药	1,806,014.00	18.06
5	600094	大名城	1,798,008.00	17.98
6	600970	中材国际	1,780,399.00	17.80
7	600312	平高电气	1,766,249.00	17.66
8	002309	中利集团	1,765,367.28	17.65
9	000810	创维数字	1,738,098.00	17.38
10	000681	视觉中国	1,734,953.00	17.35
11	600240	华业资本	1,728,978.20	17.29
12	603568	伟明环保	1,686,683.50	16.87
13	600736	苏州高新	1,678,367.37	16.78
14	000999	华润三九	1,674,617.00	16.75
15	000636	风华高科	1,665,143.00	16.65

16	600826	兰生股份	1,658,621.24	16.59
17	601231	环旭电子	1,640,730.00	16.41
18	600216	浙江医药	1,618,414.00	16.18
19	600978	宜华生活	1,605,094.00	16.05
20	300202	聚龙股份	1,594,001.00	15.94
21	000581	威孚高科	1,573,433.00	15.73
22	002051	中工国际	1,545,638.00	15.46
23	002463	沪电股份	1,536,587.00	15.37
24	603328	依顿电子	1,515,769.00	15.16
25	600981	汇鸿集团	1,487,668.00	14.88
26	603567	珍宝岛	1,487,185.00	14.87
27	002221	东华能源	1,485,161.00	14.85
28	600872	中炬高新	1,483,441.00	14.83
29	600850	华东电脑	1,453,174.00	14.53
30	002118	紫鑫药业	1,436,618.00	14.37
31	600366	宁波韵升	1,430,456.00	14.30
32	600694	大商股份	1,427,138.00	14.27
33	000825	太钢不锈	1,415,700.00	14.16
34	300287	飞利信	1,410,581.00	14.11
35	002233	塔牌集团	1,399,608.34	14.00
36	000598	兴蓉环境	1,391,806.00	13.92
37	600862	中航高科	1,357,244.00	13.57
38	600162	香江控股	1,350,031.94	13.50
39	300043	星辉娱乐	1,336,581.00	13.37
40	600751	天海投资	1,330,792.00	13.31
41	002238	天威视讯	1,329,532.49	13.29
42	001696	宗申动力	1,326,187.00	13.26
43	002414	高德红外	1,313,795.00	13.14
44	600750	江中药业	1,312,935.00	13.13
45	600026	中远海能	1,294,182.00	12.94
46	000631	顺发恒业	1,274,984.08	12.75

47	300297	蓝盾股份	1,248,580.00	12.49
48	000030	富奥股份	1,234,512.00	12.34
49	600586	金晶科技	1,219,775.00	12.20
50	000662	天夏智慧	1,202,026.00	12.02
51	600180	瑞茂通	1,199,004.00	11.99
52	600537	亿晶光电	1,195,858.76	11.96
53	603698	航天工程	1,188,664.00	11.89
54	600825	新华传媒	1,178,730.00	11.79
55	000969	安泰科技	1,173,766.00	11.74
56	600597	光明乳业	1,156,239.00	11.56
57	000552	靖远煤电	1,146,381.00	11.46
58	601929	吉视传媒	1,088,736.00	10.89
59	600458	时代新材	1,075,474.00	10.75
60	600874	创业环保	1,075,127.00	10.75
61	000973	佛塑科技	1,064,132.00	10.64
62	000910	大亚圣象	1,063,024.00	10.63
63	600917	重庆燃气	1,052,516.00	10.52
64	002477	雏鹰农牧	1,023,629.00	10.24
65	000959	首钢股份	1,019,142.12	10.19
66	601677	明泰铝业	1,017,840.00	10.18
67	002563	森马服饰	1,016,172.00	10.16
68	601137	博威合金	986,109.38	9.86
69	600984	建设机械	972,298.00	9.72
70	002410	广联达	958,419.00	9.58
71	002179	中航光电	956,517.81	9.56
72	002551	尚荣医疗	953,624.00	9.54
73	002572	索菲亚	931,904.00	9.32
74	002392	北京利尔	930,963.00	9.31
75	002680	长生生物	905,023.20	9.05
76	002106	莱宝高科	897,072.00	8.97
77	300407	凯发电气	877,016.00	8.77

78	600093	禾嘉股份	866,709.00	8.67
79	600683	京投发展	825,532.04	8.25
80	002534	杭锅股份	824,094.50	8.24
81	300158	振东制药	802,260.00	8.02
82	002482	广田集团	799,299.00	7.99
83	600823	世茂股份	793,029.00	7.93
84	002437	誉衡药业	776,723.99	7.77
85	000762	西藏矿业	768,993.00	7.69
86	600602	云赛智联	766,681.00	7.67
87	002246	北化股份	758,632.00	7.59
88	600405	动力源	735,699.00	7.36
89	601339	百隆东方	734,925.00	7.35
90	601898	中煤能源	732,587.00	7.33
91	600891	秋林集团	729,791.00	7.30
92	600270	外运发展	712,590.00	7.13
93	002422	科伦药业	707,602.90	7.08
94	601139	深圳燃气	685,033.38	6.85
95	000880	潍柴重机	679,794.00	6.80
96	000028	国药一致	676,422.00	6.76
97	002050	三花智控	661,543.00	6.62
98	002182	云海金属	659,676.00	6.60
99	600079	人福医药	656,387.00	6.56
100	600183	生益科技	652,291.64	6.52
101	600755	厦门国贸	647,461.00	6.47
102	002249	大洋电机	646,487.00	6.46
103	603883	老百姓	645,913.00	6.46
104	000863	三湘印象	642,107.00	6.42
105	600644	乐山电力	630,809.00	6.31
106	000587	金洲慈航	626,447.00	6.26
107	600864	哈投股份	613,500.00	6.13
108	600028	中国石化	600,595.00	6.01

109	002092	中泰化学	597,589.00	5.98
110	600522	中天科技	589,229.00	5.89
111	600835	上海机电	587,361.00	5.87
112	300067	安诺其	554,207.00	5.54
113	000723	美锦能源	551,216.00	5.51
114	600801	华新水泥	544,930.00	5.45
115	002004	华邦健康	537,154.00	5.37
116	002014	永新股份	533,203.00	5.33
117	002407	多氟多	532,876.00	5.33
118	600201	生物股份	526,452.00	5.26
119	600483	福能股份	512,098.00	5.12
120	000620	新华联	510,623.00	5.11
121	002701	奥瑞金	505,420.00	5.05
122	300324	旋极信息	495,651.00	4.96
123	300265	通光线缆	495,380.00	4.95
124	002595	豪迈科技	489,888.87	4.90
125	002460	赣锋锂业	483,331.00	4.83
126	600175	美都能源	481,480.00	4.81
127	600487	亨通光电	476,715.00	4.77
128	300050	世纪鼎利	474,573.00	4.75
129	300138	晨光生物	473,995.52	4.74
130	002311	海大集团	472,794.00	4.73
131	603806	福斯特	463,110.00	4.63
132	600748	上实发展	462,557.00	4.63
133	300023	宝德股份	461,509.00	4.61
134	603866	桃李面包	450,463.00	4.50
135	000418	小天鹅A	448,268.00	4.48
136	000421	南京公用	445,260.00	4.45
137	002027	分众传媒	436,119.00	4.36
138	603018	中设集团	435,098.84	4.35
139	000021	深科技	431,476.00	4.31

140	002217	合力泰	422,532.00	4.23
141	600267	海正药业	416,951.00	4.17
142	600894	广日股份	413,458.00	4.13
143	600418	江淮汽车	410,781.00	4.11
144	002317	众生药业	410,485.00	4.10
145	002019	亿帆医药	408,156.00	4.08
146	600851	海欣股份	406,212.00	4.06
147	002078	太阳纸业	406,190.00	4.06
148	600600	青岛啤酒	405,983.00	4.06
149	600219	南山铝业	405,923.00	4.06
150	000656	金科股份	396,225.00	3.96
151	600515	海航基础	395,958.26	3.96
152	000050	深天马A	387,864.00	3.88
153	600557	康缘药业	387,751.00	3.88
154	600233	圆通速递	384,777.00	3.85
155	300199	翰宇药业	379,208.00	3.79
156	600776	东方通信	377,912.00	3.78
157	000550	江铃汽车	372,247.00	3.72
158	600184	光电股份	370,338.00	3.70
159	603868	飞科电器	369,422.00	3.69
160	600362	江西铜业	364,491.00	3.64
161	000703	恒逸石化	364,241.00	3.64
162	600338	西藏珠峰	363,878.00	3.64
163	002271	东方雨虹	362,745.00	3.63
164	600143	金发科技	362,537.87	3.63
165	002624	完美世界	361,721.00	3.62
166	000543	皖能电力	354,950.00	3.55
167	600409	三友化工	352,517.00	3.53
168	300182	捷成股份	343,614.00	3.44
169	600138	中青旅	336,383.00	3.36
170	600176	中国巨石	335,810.00	3.36

171	000900	现代投资	334,057.00	3.34
172	600601	方正科技	333,363.00	3.33
173	002285	世联行	331,588.00	3.32
174	000426	兴业矿业	330,803.97	3.31
175	000528	柳工	328,645.00	3.29
176	000998	隆平高科	328,081.00	3.28
177	600584	长电科技	325,432.00	3.25
178	600056	中国医药	324,634.00	3.25
179	600298	安琪酵母	324,380.00	3.24
180	300113	顺网科技	322,157.00	3.22
181	000040	东旭蓝天	321,011.00	3.21
182	600410	华胜天成	317,988.00	3.18
183	002615	哈尔斯	317,498.00	3.17
184	300116	坚瑞沃能	314,197.00	3.14
185	002405	四维图新	312,629.00	3.13
186	002266	浙富控股	312,091.00	3.12
187	600062	华润双鹤	308,320.20	3.08
188	002013	中航机电	306,607.00	3.07
189	600770	综艺股份	306,075.00	3.06
190	600517	置信电气	305,526.00	3.06
191	000671	阳光城	303,378.00	3.03
192	000596	古井贡酒	301,498.60	3.01
193	600320	振华重工	301,238.00	3.01
194	002327	富安娜	300,679.00	3.01
195	000830	鲁西化工	300,586.00	3.01
196	300026	红日药业	300,353.00	3.00
197	600803	新奥股份	299,807.38	3.00
198	600105	永鼎股份	299,612.00	3.00
199	000997	新大陆	298,258.00	2.98
200	603188	亚邦股份	298,046.00	2.98
201	000600	建投能源	297,857.00	2.98



202	603077	和邦生物	295,767.00	2.96
203	000034	神州数码	295,401.00	2.95
204	600426	华鲁恒升	294,207.00	2.94
205	600039	四川路桥	293,765.00	2.94
206	600761	安徽合力	291,474.73	2.91
207	601989	中国重工	290,725.00	2.91
208	600236	桂冠电力	287,814.00	2.88
209	600811	东方集团	283,723.00	2.84
210	002573	清新环境	280,339.00	2.80
211	002064	华峰氨纶	275,052.00	2.75
212	600203	福日电子	274,905.60	2.75
213	002727	一心堂	269,626.00	2.70
214	002041	登海种业	269,322.00	2.69
215	600059	古越龙山	268,552.00	2.69
216	002612	朗姿股份	268,303.28	2.68
217	600195	中牧股份	267,618.00	2.68
218	600884	杉杉股份	263,771.00	2.64
219	000667	美好置业	263,347.00	2.63
220	600812	华北制药	259,509.00	2.59
221	601678	滨化股份	259,059.00	2.59
222	002206	海利得	258,846.00	2.59
223	600329	中新药业	257,214.00	2.57
224	000501	鄂武商A	256,125.00	2.56
225	600516	方大炭素	255,525.00	2.56
226	000758	中色股份	255,244.00	2.55
227	600566	济川药业	255,111.00	2.55
228	600064	南京高科	252,413.00	2.52
229	600780	通宝能源	251,793.00	2.52
230	000591	太阳能	250,253.32	2.50
231	002589	瑞康医药	249,576.24	2.50
232	600869	智慧能源	249,518.00	2.50

233	000813	德展健康	248,189.00	2.48
234	600643	爱建集团	248,186.00	2.48
235	002419	天虹商场	246,925.00	2.47
236	600198	大唐电信	245,885.00	2.46
237	600879	航天电子	245,358.00	2.45
238	300166	东方国信	243,353.00	2.43
239	600503	华丽家族	242,824.00	2.43
240	000429	粤高速A	240,874.00	2.41
241	600509	天富能源	238,154.00	2.38
242	603025	大豪科技	237,143.76	2.37
243	601126	四方股份	234,697.00	2.35
244	300274	阳光电源	233,676.00	2.34
245	601908	京运通	232,525.00	2.33
246	600482	中国动力	232,500.00	2.32
247	002085	万丰奥威	232,368.00	2.32
248	300253	卫宁健康	232,249.00	2.32
249	002203	海亮股份	232,104.00	2.32
250	000761	本钢板材	230,400.00	2.30
251	600158	中体产业	228,889.00	2.29
252	002122	天马股份	228,510.26	2.29
253	002100	天康生物	228,382.00	2.28
254	000748	长城信息	226,147.00	2.26
255	601801	皖新传媒	219,378.00	2.19
256	002056	横店东磁	219,176.00	2.19
257	002654	万润科技	218,482.00	2.18
258	603001	奥康国际	218,313.56	2.18
259	600348	阳泉煤业	215,875.00	2.16
260	600635	大众公用	215,306.00	2.15
261	600510	黑牡丹	214,076.00	2.14
262	601515	东风股份	213,662.38	2.14
263	600525	长园集团	213,094.00	2.13

264	000572	海马汽车	212,622.00	2.13
265	300048	合康新能	212,541.00	2.13
266	601689	拓普集团	212,509.00	2.13
267	600266	北京城建	212,284.00	2.12
268	603766	隆鑫通用	211,914.06	2.12
269	603377	东方时尚	211,758.92	2.12
270	002299	圣农发展	211,396.00	2.11
271	002049	紫光国芯	210,606.00	2.11
272	002277	友阿股份	210,460.00	2.10
273	300156	神雾环保	208,542.00	2.09
274	000488	晨鸣纸业	207,849.00	2.08
275	002681	奋达科技	207,467.00	2.07
276	300136	信维通信	205,767.00	2.06
277	002416	爱施德	205,742.00	2.06
278	002194	武汉凡谷	204,403.00	2.04
279	000661	长春高新	204,136.00	2.04
280	600436	片仔癀	202,258.00	2.02
281	600500	中化国际	201,823.00	2.02
282	600720	祁连山	201,621.00	2.02
283	300115	长盈精密	200,840.00	2.01
284	000990	诚志股份	200,266.00	2.00

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002078	太阳纸业	398,861.00	3.99
2	002311	海大集团	397,796.00	3.98
3	600835	上海机电	392,033.35	3.92
4	600184	光电股份	370,361.00	3.70

5	600409	三友化工	364,520.00	3.65
6	000418	小天鹅A	341,803.00	3.42
7	300182	捷成股份	341,717.88	3.42
8	600664	哈药股份	327,691.00	3.28
9	600803	新奥股份	321,759.00	3.22
10	000900	现代投资	316,832.00	3.17
11	000550	江铃汽车	313,190.96	3.13
12	000671	阳光城	309,286.00	3.09
13	600039	四川路桥	304,370.00	3.04
14	603077	和邦生物	303,880.00	3.04
15	600201	生物股份	302,320.00	3.02
16	600970	中材国际	301,525.00	3.02
17	002217	合力泰	295,012.00	2.95
18	600826	兰生股份	292,813.00	2.93
19	601929	吉视传媒	290,528.00	2.91
20	600320	振华重工	289,284.00	2.89
21	000596	古井贡酒	288,581.00	2.89
22	600761	安徽合力	283,699.00	2.84
23	002041	登海种业	283,276.00	2.83
24	000600	建投能源	282,410.00	2.82
25	600203	福日电子	279,200.00	2.79
26	000830	鲁西化工	275,210.00	2.75
27	000050	深天马A	275,153.00	2.75
28	600059	古越龙山	274,981.00	2.75
29	000501	鄂武商A	272,638.00	2.73
30	002064	华峰氨纶	272,174.00	2.72
31	600851	海欣股份	264,612.00	2.65
32	600240	华业资本	261,346.00	2.61
33	300202	聚龙股份	260,629.00	2.61
34	601678	滨化股份	258,834.80	2.59
35	600329	中新药业	252,548.00	2.53

36	600780	通宝能源	250,044.00	2.50
37	002419	天虹商场	248,008.00	2.48
38	600823	世茂股份	247,416.20	2.47
39	603025	大豪科技	246,563.00	2.47
40	600884	杉杉股份	246,138.00	2.46
41	601908	京运通	245,825.09	2.46
42	600566	济川药业	245,743.00	2.46
43	002309	中利集团	245,646.00	2.46
44	002179	中航光电	244,770.00	2.45
45	600601	方正科技	242,334.00	2.42
46	600509	天富能源	241,695.00	2.42
47	600869	智慧能源	241,567.00	2.42
48	600143	金发科技	240,501.00	2.40
49	002085	万丰奥威	239,025.00	2.39
50	002595	豪迈科技	235,296.00	2.35
51	000030	富奥股份	233,898.00	2.34
52	600510	黑牡丹	233,336.00	2.33
53	600026	中远海能	232,409.00	2.32
54	601126	四方股份	231,403.00	2.31
55	603328	依顿电子	230,796.00	2.31
56	002122	天马股份	230,786.15	2.31
57	600482	中国动力	229,176.00	2.29
58	600219	南山铝业	228,003.00	2.28
59	601801	皖新传媒	226,936.00	2.27
60	000612	焦作万方	225,476.00	2.25
61	600525	长园集团	224,841.20	2.25
62	603001	奥康国际	224,539.00	2.25
63	002194	武汉凡谷	218,189.00	2.18
64	600064	南京高科	218,014.00	2.18
65	600056	中国医药	217,205.00	2.17
66	601515	东风股份	215,276.00	2.15

67	002299	圣农发展	214,453.84	2.14
68	002437	誉衡药业	211,738.00	2.12
69	601188	龙江交通	210,091.00	2.10
70	600720	祁连山	209,600.61	2.10
71	600348	阳泉煤业	207,415.00	2.07
72	600812	华北制药	206,704.00	2.07
73	000998	隆平高科	206,502.00	2.06
74	601012	隆基股份	206,015.00	2.06
75	600811	东方集团	204,772.00	2.05
76	000429	粤高速A	203,806.00	2.04
77	600587	新华医疗	202,382.94	2.02
78	600426	华鲁恒升	200,140.00	2.00

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	226,080,352.86
卖出股票收入（成交）总额	62,827,417.68

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1

山东未名生物医药股份有限公司（下称“未名医药”，股票代码：002581）于2016年初收到山东证监局的整改通知，指出该公司2015年年报存在信息披露不充分的问题，主要包括：（一）实际控制人在关联单位的任职信息披露不充分；（二）部分关联方及关联交易披露不充分。

本基金投研人员分析认为，未名医药在接到山东证监局的整改通知后，快速做出反应，查找不足，积极整改；该事件对公司经营并无实质性影响，事件发生后公司经营状况正常。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未名医药进行了投资。

##### 8.12.2

本报告期内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。

##### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,546.16
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	10,781.53
5	应收申购款	26,001.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	39,329.15
---	----	-----------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
创金合 信中证 500增强 A	43	4,090,007. 15	175,683,80 6.27	99.89%	186,501.24	0.11%
创金合 信中证 500增强 C	70	106,940.37	5,000,000. 00	66.79%	2,485,825. 56	33.21%
合计	110	1,666,873. 94	180,683,80 6.27	98.54%	2,672,326. 80	1.46%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------



基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证500增强A	14,283.32	0.008122%
	创金合信中证500增强C	381,367.47	5.094528%
	合计	395,650.79	0.215783%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0
	创金合信中证500增强C	0
	合计	0

### 9.4 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	10,000,000.00	5.45%	10,000,000.00	5.45%	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	10,000,000.00	5.45%	10,000,000.00	5.45%	
----	---------------	-------	---------------	-------	--

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证500增强 A	创金合信中证500增强 C
基金合同生效日(2015年12月31日) 基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期基金总申购份额	171,063,264.54	4,206,211.38
减：本报告期基金总赎回份额	192,957.03	1,720,385.82
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	175,870,307.51	7,485,825.56

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略无重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用30,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为1年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	42,301,857.45	14.64%	30,523.71	11.85%	
光大证券	2	246,605,913.09	85.36%	227,167.66	88.15%	

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期新增光大证券的2个交易单元。

注：本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券日报	2016-01-04
2	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券日报	2016-01-09
3	创金合信基金管理有限公司关于	公司官网、证券日报	2016-01-22

	创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金增加代销机构的公告		
4	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	公司官网、证券日报	2016-01-23
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-03-30
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-04-13
7	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-04-20
8	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	公司官网、证券日报	2016-04-22
9	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-06-02
10	创金合信基金管理有限公司关于旗下基金开展微信直销平台认购费率优惠活动的公告	公司官网、证券日报	2016-06-24
11	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年第2季度报告	公司官网、证券日报	2016-07-20
12	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-07-28
13	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2016年第	公司官网、证券日报	2016-08-14

	1号) 招募说明书 (更新)		
14	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金 (2016年第1号) 招募说明书 (摘要)	公司官网、证券日报	2016-08-14
15	创金合信基金关于调整官方微信平台认购及申购费率的公告	公司官网、证券日报	2016-08-17
16	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加诺亚财富为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-08-24
17	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加京东金融为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-08-26
18	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年半年度报告	公司官网、证券日报	2016-08-27
19	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年半年度报告摘要	公司官网、证券日报	2016-08-27
20	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加大泰金石为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-09-06
21	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加中信建投为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-09-23
22	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加大智慧财富为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-10-18
23	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-10-20
24	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销	公司官网、证券日报	2016-10-20

	机构的公告		
25	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年第3季度报告	公司官网、证券日报	2016-10-24
26	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加金融界为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-11-01
27	创金合信基金关于针对旗下部分开放式证券投资基金调整直销柜台申购金额的公告	公司官网、证券日报	2016-11-24
28	创金合信基金管理有限公司关于养老金账户通过直销柜台申购、转换转入旗下部分基金产品费率优惠的公告	公司官网、证券日报	2016-11-26
29	创金合信基金关于针对旗下部分开放式证券投资基金调整直销柜台申购费率的公告	公司官网、证券日报	2016-12-08
30	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加华信证券为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-12-15
31	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加和讯为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-12-23
32	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购的公告	公司官网、证券日报	2016-12-23
33	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加永鑫保险为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2016-12-28

### § 12 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。

### § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2016年年度报告

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 13.3 查阅方式

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

创金合信基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十七日