

创金合信沪深300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	15
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	17
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	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	67

§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信沪深300增强	
基金主代码	002310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月31日	
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	219,660,945.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	002310	002315
报告期末下属分级基金的份 额总额	214,235,996.89份	5,424,948.88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	沪深300指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金

	主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
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	创金合信沪深300增强A	
	2016年	2015年12月31日-2015年12月31日
本期已实现收益	-564,150.41	200.00
本期利润	-1,098,812.30	200.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1097	—
本期加权平均净值利润率	-11.76%	—
本期基金份额净值增长率	-4.68%	—
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-11,873,179.91	200.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0554	—
期末基金资产净值	204,205,414.52	5,000,200.00
期末基金份额净值	0.9532	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	-4.68%	—

3.1.4 期间数据和指标	创金合信沪深300增强C	
	2016年	2015年12月31日-2015年12月31日

本期已实现收益	-245,874.56	200.00
本期利润	-545,590.40	200.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0985	—
本期加权平均净值利润率	-10.72%	—
本期基金份额净值增长率	-4.13%	—
3.1.5 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-270,384.78	200.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0498	—
期末基金资产净值	5,200,757.64	5,000,200.00
期末基金份额净值	0.9587	1.0000
3.1.6 累计期末指标	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	-4.13%	—

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。

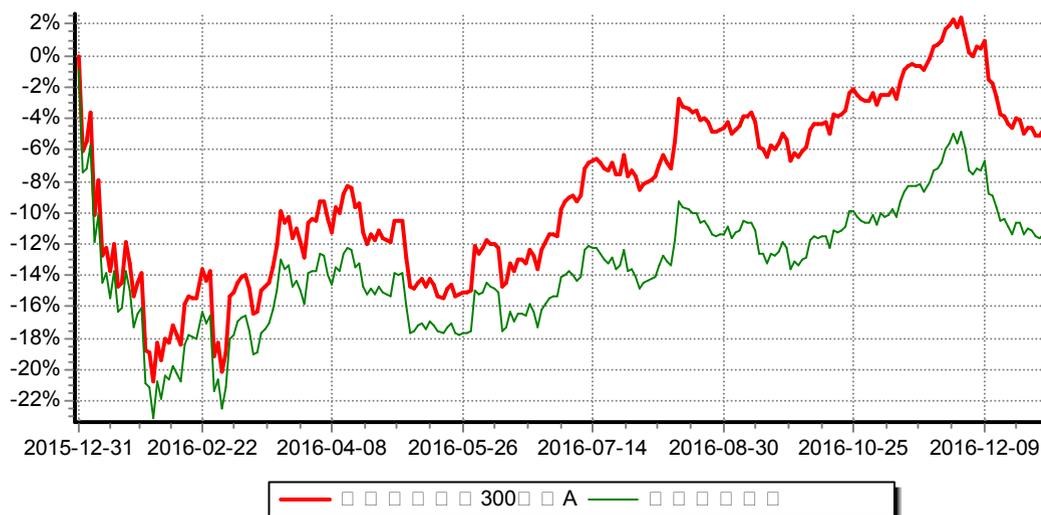
3.2 基金净值表现

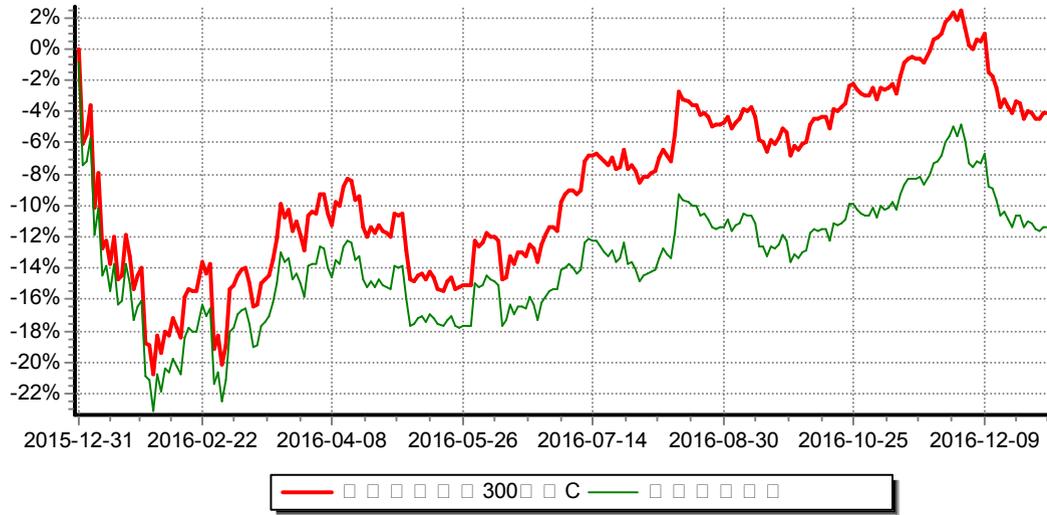
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (创金合信沪深300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	1.21%	0.67%	1.68%	0.67%	-0.47%	0.00%
过去六个月	7.56%	0.72%	4.75%	0.72%	2.81%	0.00%
过去一年	-4.68%	1.37%	-10.58%	1.33%	5.90%	0.04%
自基金合同生效日起至今(2015年12月31日-2016年12月31日)	-4.68%	1.36%	-11.35%	1.33%	6.67%	0.03%

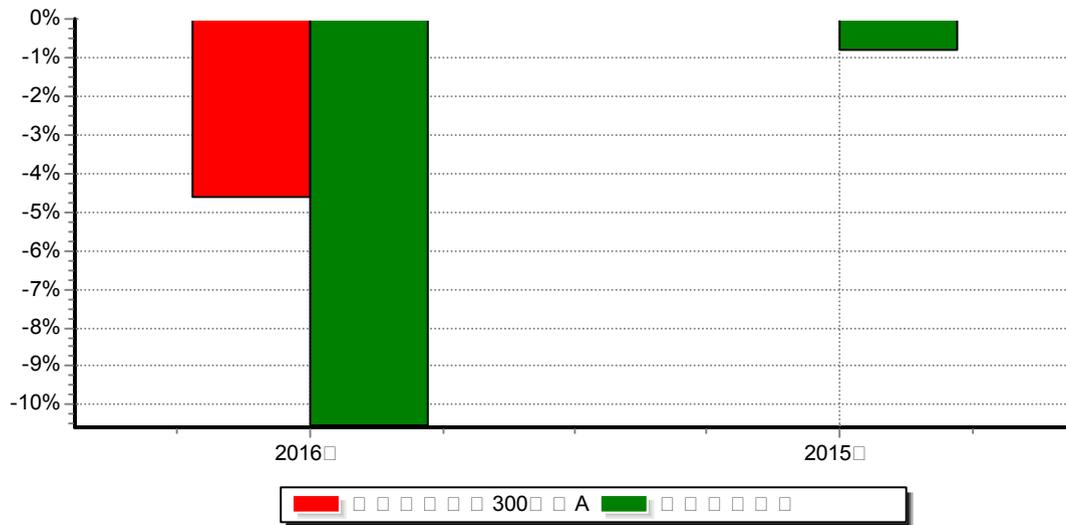
阶段 (创金合信沪深300增强C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.87%	0.67%	1.68%	0.67%	0.19%	0.00%
过去六个月	8.23%	0.72%	4.75%	0.72%	3.48%	0.00%
过去一年	-4.13%	1.37%	-10.58%	1.33%	6.45%	0.04%
自基金合同生效日起至今 (2015年12月31日-2016年12月31日)	-4.13%	1.36%	-11.35%	1.33%	7.22%	0.03%

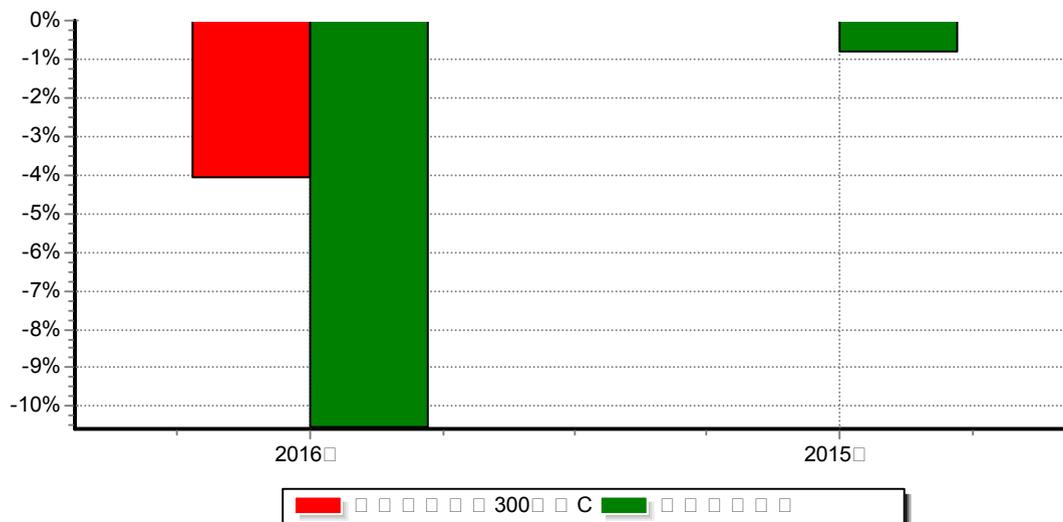
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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、《创金合信沪深300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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共1次，为基金在调仓时点因选股模型和其他基金选股模型产生分歧而发生的反向交易，未对当天的股票价格产生冲击。

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选股依据；另一方面，仓位管理上我们严格按照量化择时模型进行操作。

4.4.2 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-4.68%，C级净值增长率-4.13%，同期业绩比较基准收益率为-10.58%。

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22105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	创金合信沪深300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沪深300指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“创金合信沪深300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	编制和公允列报财务报表是创金合信沪深300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： (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； (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。
注册会计师的责任段	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。

	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。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。
审计意见段	我们认为，上述创金合信沪深300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。
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：创金合信沪深300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
资产：			

银行存款	7.4.7.1	11,077,737.55	10,000,000.00
结算备付金		88,701.48	
存出保证金		3,768.48	—
交易性金融资产	7.4.7.2	198,542,580.46	—
其中：股票投资		198,542,580.46	—
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	11,774.86	400.00
应收股利		—	—
应收申购款		5,491.76	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		209,730,054.59	10,000,400.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
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		3,054.09	—
应付管理人报酬		41,472.39	—
应付托管费		5,184.04	—
应付销售服务费		727.61	—
应付交易费用	7.4.7.7	233,444.07	—

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	40,000.23	—
负债合计		323,882.43	—
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	219,660,945.77	10,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-10,254,773.61	400.00
所有者权益合计		209,406,172.16	10,000,400.00
负债和所有者权益总计		209,730,054.59	10,000,400.00

注：1. 报告截止日2016年12月31日，基金份额总额219,660,945.77份，其中下属A类基金份额214,235,996.89份，C类基金份额5,424,948.88份。下属A类基金份额净值0.9532元，C类基金份额净值0.9587元。

2. 本基金合同生效日为2015年12月31日，上年度可比期间为2015年12月31日至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：创金合信沪深300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
一、收入		-1,066,228.33	400.00
1. 利息收入		16,972.22	400.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,972.22	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“-”填列）		-290,615.09	—
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-469,250.01	—
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	178,634.92	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-834,377.73	—
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	41,792.27	—
减：二、费用		578,174.37	—
1. 管理人报酬		109,469.67	—
2. 托管费		13,683.69	—
3. 销售服务费		5,043.57	—
4. 交易费用	7.4.7.18	378,370.84	—
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	71,606.60	—
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,644,402.70	400.00
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,644,402.70	400.00

注：本基金合同生效日为2015年12月31日，上年度可比期间为2015年12月31日至2015年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信沪深300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）	—	1,644,402.70	-1,644,402.70
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）	209,660,945.77	8,610,770.91	201,050,174.86
其中：1. 基金申购款	218,984,563.23	8,972,737.82	210,011,825.41
2. 基金赎回款	-9,323,617.46	361,966.91	-8,961,650.55
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）	219,660,945.77	10,254,773.61	209,406,172.16
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：本基金合同生效日为2015年12月31日，上年度可比期间为2015年12月31日至2015年12月31日。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

创金合信沪深300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]3045号《关于准予创金合信沪深300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《创金合信沪深300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1504号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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《创金合信沪深300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: 沪深300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》、《创金合信沪深300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 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和债券，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	11,077,737.55	10,000,000.00
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	11,077,737.55	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	199,376,958.19	198,542,580.46	-834,377.73
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	199,376,958.19	198,542,580.46	-834,377.73
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

本基金本期末及上年度末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	11,729.10	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	43.89	—
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	1.87	—
合计	11,774.86	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	233,444.07	—
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	233,444.07	—

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	0.23	—
预提费用	40,000.00	—
合计	40,000.23	—

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (创金合信沪深300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	209,585,662.43	209,585,662.43
本期赎回(以“-”号填列)	-349,665.54	-349,665.54
本期末	214,235,996.89	214,235,996.89
项目 (创金合信沪深300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	9,398,900.80	9,398,900.80
本期赎回(以“-”号填列)	-8,973,951.92	-8,973,951.92
本期末	5,424,948.88	5,424,948.88

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (创金合信沪深 300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	-564,150.41	-534,661.89	-1,098,812.30
本期基金份额交易 产生的变动数	-11,309,229.50	2,377,259.43	-8,931,970.07
其中：基金申购款	-11,326,552.87	2,378,836.79	-8,947,716.08
基金赎回款	17,323.37	-1,577.36	15,746.01
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-11,873,179.91	1,842,597.54	-10,030,582.37

单位：人民币元

项目 (创金合信沪深 300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	-245,874.56	-299,715.84	-545,590.40
本期基金份额交易 产生的变动数	-24,710.22	345,909.38	321,199.16
其中：基金申购款	-431,009.68	405,987.94	-25,021.74
基金赎回款	406,299.46	-60,078.56	346,220.90
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-270,384.78	46,193.54	-224,191.24

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	16,235.22	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	692.47	—
其他	44.53	—
合计	16,972.22	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 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
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-469,250.01	—
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	-469,250.01	—

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	60,409,312.87	—
减：卖出股票成本总额	60,878,562.88	—
买卖股票差价收入	-469,250.01	—

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	178,634.92	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	178,634.92	—

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	-834,377.73	—
——股票投资	-834,377.73	—
——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	-834,377.73	—

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	41,792.27	—
合计	41,792.27	—

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	378,370.84	—
银行间市场交易费用	—	—
合计	378,370.84	—

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	1,606.60	—
合计	71,606.60	—

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	35,252,486.84	10.99%		—

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间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	25,482.05	8.80%	—	—
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	—	—	—	—

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	109,469.67	—
其中：支付销售机构的客户维护费	775.36	—

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X 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	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
当期发生的基金应支付的托管费	13,683.69	—

注：支付基金托管人 招商银行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X 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		
	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300增强C	合计
创金合信	—	4,880.45	4,880.45
合计	—	4880.45	4880.45
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		
	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300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

本基金本期末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	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	
	创金合信沪 深300增强A	创金合信沪 深300增强C	创金合信沪 深300增强A	创金合信沪 深300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	2.33%	92.17%	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

本基金本期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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	11,077,737.55	16,235.22	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

本基金于本期末未进行利润分配。

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
600090	同济堂	2016-12-26	重大事项停牌	11.75	2017-01-10	12.93	8,300	98,438.00	97,525.00
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60			21,000	339,518.84	306,600.00
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项停牌	35.80	2017-01-16	36.88	300	12,669.52	10,740.00

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	11,077,737 .55	—	—	—	11,077,737 .55
结算备付金	88,701.48	—	—	—	88,701.48
存出保证金	3,768.48	—	—	—	3,768.48
交易性金融资	—	—	—	198,542,58	198,542,58

产				0.46	0.46
应收利息	—	—	—	11,774.86	11,774.86
应收申购款	—	—	—	5,491.76	5,491.76
资产总计	11,170,207.51	—	—	198,559,847.08	209,730,054.59
负债					
应付赎回款	—	—	—	3,054.09	3,054.09
应付管理人报酬	—	—	—	41,472.39	41,472.39
应付托管费	—	—	—	5,184.04	5,184.04
应付销售服务费	—	—	—	727.61	727.61
应付交易费用	—	—	—	233,444.07	233,444.07
其他负债	—	—	—	40,000.23	40,000.23
负债总计	—	—	—	323,882.43	323,882.43
利率敏感度缺口	11,170,207.51	—	—	198,235,964.65	209,406,172.16
上年度末 2015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	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	上年度末

	2016年12月31日		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	198,542,580.46	94.81	—	—
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	198,542,580.46	94.81	—	—

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	10,820,570.64	—
	比较基准下降5%资产净值变动	-10,820,570.64	—

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198,127,715.46元，属于第二层次的余额为414,865.00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	198,542,580.46	94.67
	其中：股票	198,542,580.46	94.67
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	11,166,439.03	5.32
7	其他各项资产	21,035.10	0.01
8	合计	209,730,054.59	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	211,848.00	0.10
B	采矿业	5,381,729.00	2.57
C	制造业	39,233,080.50	18.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,800,827.00	2.29
E	建筑业	8,242,718.00	3.94
F	批发和零售业	5,337,564.00	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	4,750,796.00	2.27
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,194,922.00	1.05
J	金融业	72,575,135.96	34.66
K	房地产业	9,031,240.00	4.31
L	租赁和商务服务业	4,299,139.00	2.05
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	19,272.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	2,955,591.00	1.41

S	综合	—	—
	合计	159,033,862.46	75.95

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	141,284.00	0.07
B	采矿业	—	—
C	制造业	25,808,258.00	12.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,020,427.00	1.44
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,040,695.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,254,158.00	0.60
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,335,619.00	1.59
J	金融业	116,400.00	0.06
K	房地产业	2,225,249.00	1.06
L	租赁和商务服务业	1,136,800.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	429,828.00	0.21
S	综合	—	—
	合计	39,508,718.00	18.87

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	601318	中国平安	287,982	10,203,202.26	4.87
2	600016	民生银行	490,000	4,449,200.00	2.12
3	601166	兴业银行	256,300	4,136,682.00	1.98
4	600837	海通证券	260,000	4,095,000.00	1.96
5	601668	中国建筑	460,900	4,083,574.00	1.95
6	601989	中国重工	574,000	4,069,660.00	1.94
7	601398	工商银行	907,700	4,002,957.00	1.91
8	601939	建设银行	717,400	3,902,656.00	1.86
9	600104	上汽集团	165,300	3,876,285.00	1.85
10	601288	农业银行	1,156,300	3,584,530.00	1.71
11	601988	中国银行	1,035,400	3,561,776.00	1.70
12	601328	交通银行	539,300	3,111,761.00	1.49
13	600362	江西铜业	183,800	3,074,974.00	1.47
14	000063	中兴通讯	191,100	3,048,045.00	1.46
15	600028	中国石化	544,800	2,947,368.00	1.41
16	600606	绿地控股	330,900	2,882,139.00	1.38
17	600015	华夏银行	257,100	2,789,535.00	1.33
18	000776	广发证券	164,700	2,776,842.00	1.33
19	000651	格力电器	112,400	2,767,288.00	1.32
20	002027	分众传媒	192,400	2,745,548.00	1.31
21	601688	华泰证券	153,600	2,743,296.00	1.31
22	600023	浙能电力	485,500	2,636,265.00	1.26
23	600030	中信证券	159,300	2,558,358.00	1.22
24	601607	上海医药	129,000	2,523,240.00	1.20
25	600221	海南航空	710,500	2,316,230.00	1.11
26	600519	贵州茅台	6,700	2,238,805.00	1.07
27	601377	兴业证券	273,500	2,092,275.00	1.00
28	600900	长江电力	163,500	2,069,910.00	0.99

29	601555	东吴证券	155,300	2,060,831.00	0.98
30	000002	万科A	99,300	2,040,615.00	0.97
31	600297	广汇汽车	227,400	1,946,544.00	0.93
32	600373	中文传媒	94,600	1,910,920.00	0.91
33	601818	光大银行	469,300	1,834,963.00	0.88
34	600000	浦发银行	111,270	1,803,686.70	0.86
35	601088	中国神华	111,300	1,800,834.00	0.86
36	600029	南方航空	251,900	1,768,338.00	0.84
37	600816	安信信托	73,100	1,726,622.00	0.82
38	000627	天茂集团	220,100	1,683,765.00	0.80
39	600887	伊利股份	91,000	1,601,600.00	0.76
40	600873	梅花生物	244,400	1,593,488.00	0.76
41	000725	京东方A	552,800	1,581,008.00	0.75
42	002736	国信证券	101,500	1,578,325.00	0.75
43	000333	美的集团	54,250	1,528,222.50	0.73
44	601800	中国交建	98,300	1,493,177.00	0.71
45	600383	金地集团	113,800	1,474,848.00	0.70
46	000938	紫光股份	25,000	1,434,750.00	0.69
47	601169	北京银行	138,300	1,349,808.00	0.64
48	600208	新湖中宝	321,400	1,337,024.00	0.64
49	000709	河钢股份	398,100	1,329,654.00	0.63
50	600060	海信电器	74,800	1,280,576.00	0.61
51	600309	万华化学	52,200	1,123,866.00	0.54
52	000001	平安银行	119,900	1,091,090.00	0.52
53	600048	保利地产	116,400	1,062,732.00	0.51
54	000100	TCL 集团	319,200	1,053,360.00	0.50
55	600170	上海建工	221,900	1,049,587.00	0.50
56	300058	蓝色光标	92,300	938,691.00	0.45
57	601601	中国太保	33,500	930,295.00	0.44
58	300002	神州泰岳	99,800	922,152.00	0.44
59	600498	烽火通信	36,400	917,644.00	0.44

60	601928	凤凰传媒	87,400	915,078.00	0.44
61	600585	海螺水泥	53,300	903,968.00	0.43
62	600019	宝钢股份	136,200	864,870.00	0.41
63	601186	中国铁建	70,700	845,572.00	0.40
64	000895	双汇发展	38,000	795,340.00	0.38
65	600037	歌华有线	51,000	781,320.00	0.37
66	600648	外高桥	37,000	730,380.00	0.35
67	601006	大秦铁路	94,100	666,228.00	0.32
68	000415	渤海金控	86,000	614,900.00	0.29
69	601628	中国人寿	25,000	602,250.00	0.29
70	601901	方正证券	79,200	601,920.00	0.29
71	601211	国泰君安	32,300	600,457.00	0.29
72	600061	国投安信	38,300	597,863.00	0.29
73	601766	中国中车	57,500	561,775.00	0.27
74	600999	招商证券	34,100	556,853.00	0.27
75	601857	中国石油	69,900	555,705.00	0.27
76	002426	胜利精密	60,600	501,162.00	0.24
77	601390	中国中铁	51,600	457,176.00	0.22
78	600066	宇通客车	23,200	454,488.00	0.22
79	600196	复星医药	18,100	418,834.00	0.20
80	601009	南京银行	38,600	418,424.00	0.20
81	000858	五粮液	11,900	410,312.00	0.20
82	600958	东方证券	25,500	396,015.00	0.19
83	600276	恒瑞医药	8,420	383,110.00	0.18
84	600050	中国联通	51,800	378,658.00	0.18
85	002142	宁波银行	21,000	349,440.00	0.17
86	601669	中国电建	43,200	313,632.00	0.15
87	600485	信威集团	21,000	306,600.00	0.15
88	000425	徐工机械	80,100	270,738.00	0.13
89	600518	康美药业	14,200	253,470.00	0.12
90	601998	中信银行	34,100	218,581.00	0.10

91	002714	牧原股份	9,100	211,848.00	0.10
92	002450	康得新	10,300	196,833.00	0.09
93	002304	洋河股份	2,000	141,200.00	0.07
94	002024	苏宁云商	12,000	137,400.00	0.07
95	002415	海康威视	5,500	130,955.00	0.06
96	600177	雅戈尔	7,600	106,248.00	0.05
97	001979	招商蛇口	5,600	91,784.00	0.04
98	300251	光线传媒	9,400	91,744.00	0.04
99	601899	紫金矿业	23,300	77,822.00	0.04
100	300059	东方财富	4,400	74,492.00	0.04
101	600795	国电电力	23,400	74,178.00	0.04
102	601336	新华保险	1,600	70,048.00	0.03
103	600741	华域汽车	3,600	57,420.00	0.03
104	002466	天齐锂业	1,700	55,165.00	0.03
105	601099	太平洋	10,500	54,075.00	0.03
106	002739	万达院线	700	37,849.00	0.02
107	600340	华夏幸福	1,500	35,850.00	0.02
108	000783	长江证券	3,300	33,759.00	0.02
109	000503	海虹控股	600	25,230.00	0.01
110	601985	中国核电	2,900	20,474.00	0.01
111	300070	碧水源	1,100	19,272.00	0.01
112	300104	乐视网	300	10,740.00	0.01
113	601788	光大证券	500	7,995.00	—
114	000538	云南白药	100	7,615.00	—
115	600637	东方明珠	100	2,330.00	—

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	002600	江粉磁材	159,000	1,628,160.00	0.78
2	600602	云赛智联	161,200	1,536,236.00	0.73

3	600984	建设机械	154,800	1,352,952.00	0.65
4	000591	太阳能	99,000	1,342,440.00	0.64
5	000910	大亚圣象	69,400	1,325,540.00	0.63
6	300158	振东制药	67,400	1,319,692.00	0.63
7	300138	晨光生物	70,300	1,281,569.00	0.61
8	600162	香江控股	307,100	1,219,187.00	0.58
9	600216	浙江医药	91,400	1,158,952.00	0.55
10	600093	禾嘉股份	78,400	1,136,800.00	0.54
11	600515	海航基础	89,900	1,042,840.00	0.50
12	300048	合康新能	121,900	1,002,018.00	0.48
13	000030	富奥股份	112,800	958,800.00	0.46
14	002534	杭锅股份	82,600	921,816.00	0.44
15	600285	羚锐制药	70,900	904,684.00	0.43
16	300116	坚瑞沃能	47,200	854,320.00	0.41
17	000863	三湘印象	96,600	820,134.00	0.39
18	000429	粤高速A	118,000	807,120.00	0.39
19	300407	凯发电气	43,000	777,870.00	0.37
20	600075	新疆天业	56,900	707,836.00	0.34
21	600891	秋林集团	75,200	700,864.00	0.33
22	601137	博威合金	53,200	695,324.00	0.33
23	600644	乐山电力	75,900	695,244.00	0.33
24	600203	福日电子	57,700	677,398.00	0.32
25	601677	明泰铝业	45,500	673,400.00	0.32
26	002624	完美世界	22,500	670,275.00	0.32
27	002026	山东威达	57,600	665,280.00	0.32
28	600312	平高电气	42,000	656,040.00	0.31
29	600530	交大昂立	82,900	621,750.00	0.30
30	002517	恺英网络	18,300	614,148.00	0.29
31	000601	韶能股份	70,100	602,159.00	0.29
32	300241	瑞丰光电	36,700	591,971.00	0.28
33	002680	长生生物	34,000	588,200.00	0.28

34	002555	三七互娱	31,400	514,960.00	0.25
35	601012	隆基股份	36,400	487,396.00	0.23
36	000561	烽火电子	39,000	475,410.00	0.23
37	000662	天夏智慧	21,500	457,735.00	0.22
38	601098	中南传媒	25,800	429,828.00	0.21
39	601339	百隆东方	66,700	416,208.00	0.20
40	600600	青岛啤酒	13,500	397,440.00	0.19
41	600350	山东高速	58,100	376,488.00	0.18
42	002204	大连重工	84,600	375,624.00	0.18
43	002507	涪陵榨菜	27,400	366,612.00	0.18
44	600233	圆通速递	13,700	349,213.00	0.17
45	600236	桂冠电力	53,500	326,350.00	0.16
46	603288	海天味业	10,800	316,764.00	0.15
47	300040	九洲电气	26,900	308,274.00	0.15
48	002705	新宝股份	17,000	287,470.00	0.14
49	000989	九芝堂	13,100	284,401.00	0.14
50	002563	森马服饰	23,400	240,318.00	0.11
51	600566	济川药业	7,000	218,820.00	0.10
52	002182	云海金属	11,700	217,737.00	0.10
53	600872	中炬高新	14,900	209,792.00	0.10
54	002654	万润科技	18,900	208,656.00	0.10
55	002314	南山控股	24,400	185,928.00	0.09
56	600429	三元股份	18,400	144,440.00	0.07
57	002447	壹桥股份	14,300	141,284.00	0.07
58	300130	新国都	5,600	139,048.00	0.07
59	600755	厦门国贸	15,500	127,100.00	0.06
60	600569	安阳钢铁	41,400	123,786.00	0.06
61	601992	金隅股份	27,200	121,312.00	0.06
62	601229	上海银行	5,000	116,400.00	0.06
63	002203	海亮股份	12,100	97,526.00	0.05
64	600090	同济堂	8,300	97,525.00	0.05

65	600694	大商股份	2,400	95,832.00	0.05
66	600548	深高速	8,300	70,550.00	0.03
67	002422	科伦药业	3,900	62,868.00	0.03
68	600333	长春燃气	6,900	54,234.00	0.03
69	000898	鞍钢股份	8,200	41,328.00	0.02
70	600261	阳光照明	4,900	35,378.00	0.02
71	600183	生益科技	2,100	23,100.00	0.01
72	000959	首钢股份	2,200	14,564.00	0.01

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	601318	中国平安	10,642,058.30	106.42
2	600016	民生银行	5,499,857.00	55.00
3	600837	海通证券	4,752,195.00	47.52
4	601668	中国建筑	4,671,384.00	46.71
5	601166	兴业银行	4,656,468.00	46.56
6	601989	中国重工	4,333,992.00	43.34
7	600104	上汽集团	4,300,884.21	43.01
8	601398	工商银行	4,219,629.00	42.19
9	601939	建设银行	4,043,018.00	40.43
10	601288	农业银行	3,814,865.00	38.15
11	601988	中国银行	3,772,009.00	37.72
12	000776	广发证券	3,410,963.00	34.11
13	600028	中国石化	3,369,046.00	33.69
14	601688	华泰证券	3,313,136.00	33.13
15	000063	中兴通讯	3,312,243.00	33.12
16	601328	交通银行	3,308,072.00	33.08
17	600362	江西铜业	3,169,048.00	31.69

18	002027	分众传媒	3,071,808.00	30.72
19	600606	绿地控股	2,964,271.00	29.64
20	600030	中信证券	2,940,635.00	29.41
21	601607	上海医药	2,924,038.00	29.24
22	000651	格力电器	2,911,089.00	29.11
23	600023	浙能电力	2,851,778.50	28.52
24	600015	华夏银行	2,828,182.45	28.28
25	601555	东吴证券	2,628,620.00	26.29
26	600900	长江电力	2,351,691.50	23.52
27	600221	海南航空	2,333,471.00	23.33
28	600519	贵州茅台	2,302,399.00	23.02
29	601088	中国神华	2,289,812.00	22.90
30	601377	兴业证券	2,260,790.00	22.61
31	000002	万科A	2,259,202.00	22.59
32	600373	中文传媒	2,211,954.00	22.12
33	600000	浦发银行	2,104,083.00	21.04
34	600297	广汇汽车	2,033,110.00	20.33
35	601818	光大银行	1,987,943.00	19.88
36	600816	安信信托	1,909,219.50	19.09
37	002736	国信证券	1,867,100.00	18.67
38	600029	南方航空	1,792,743.00	17.93
39	601800	中国交建	1,783,056.50	17.83
40	600048	保利地产	1,759,409.93	17.59
41	000627	天茂集团	1,741,644.00	17.42
42	000333	美的集团	1,739,108.00	17.39
43	000725	京东方A	1,712,424.00	17.12
44	600887	伊利股份	1,702,956.00	17.03
45	600383	金地集团	1,700,491.26	17.00
46	002600	江粉磁材	1,658,227.00	16.58
47	600602	云赛智联	1,586,599.00	15.87
48	600873	梅花生物	1,578,360.00	15.78

49	601169	北京银行	1,571,804.00	15.72
50	600984	建设机械	1,556,299.46	15.56
51	300138	晨光生物	1,494,410.00	14.94
52	000591	太阳能	1,489,616.48	14.90
53	000938	紫光股份	1,462,330.00	14.62
54	000709	河钢股份	1,460,813.00	14.61
55	000910	大亚圣象	1,457,534.00	14.57
56	600060	海信电器	1,409,637.00	14.10
57	600162	香江控股	1,391,710.50	13.92
58	600208	新湖中宝	1,378,295.00	13.78
59	600170	上海建工	1,371,993.00	13.72
60	300158	振东制药	1,335,710.00	13.36
61	300002	神州泰岳	1,290,003.98	12.90
62	600309	万华化学	1,285,386.00	12.85
63	000001	平安银行	1,198,891.60	11.99
64	600216	浙江医药	1,166,084.00	11.66
65	000100	TCL 集团	1,161,049.00	11.61
66	000895	双汇发展	1,143,711.47	11.44
67	601186	中国铁建	1,130,427.00	11.30
68	600585	海螺水泥	1,126,628.00	11.27
69	600515	海航基础	1,126,126.90	11.26
70	600999	招商证券	1,125,607.11	11.26
71	601928	凤凰传媒	1,108,322.00	11.08
72	601601	中国太保	1,086,715.00	10.87
73	600093	禾嘉股份	1,081,930.00	10.82
74	000030	富奥股份	1,048,533.00	10.48
75	300048	合康新能	1,046,894.00	10.47
76	600019	宝钢股份	979,394.00	9.79
77	000429	粤高速A	971,772.00	9.72
78	601901	方正证券	951,876.41	9.52
79	600498	烽火通信	951,429.00	9.51

80	002534	杭锅股份	938,784.00	9.39
81	600037	歌华有线	903,233.00	9.03
82	601677	明泰铝业	882,425.00	8.82
83	600203	福日电子	879,859.00	8.80
84	000863	三湘印象	878,957.00	8.79
85	300116	坚瑞沃能	875,648.00	8.76
86	600285	羚锐制药	866,973.00	8.67
87	600061	国投安信	860,560.00	8.61
88	601137	博威合金	849,012.00	8.49
89	300058	蓝色光标	847,940.00	8.48
90	601006	大秦铁路	840,949.00	8.41
91	300407	凯发电气	782,168.00	7.82
92	601628	中国人寿	779,522.00	7.79
93	600050	中国联通	764,794.00	7.65
94	601857	中国石油	750,908.00	7.51
95	601766	中国中车	748,787.00	7.49
96	600648	外高桥	733,584.00	7.34
97	002624	完美世界	723,778.00	7.24
98	600891	秋林集团	707,354.00	7.07
99	600066	宇通客车	701,193.05	7.01
100	600075	新疆天业	700,695.00	7.01
101	000415	渤海金控	698,352.00	6.98
102	600312	平高电气	685,640.00	6.86
103	000858	五粮液	684,561.72	6.85
104	600644	乐山电力	681,513.00	6.81
105	600530	交大昂立	672,740.66	6.73
106	600600	青岛啤酒	672,152.00	6.72
107	002026	山东威达	666,090.25	6.66
108	601211	国泰君安	662,972.00	6.63
109	601098	中南传媒	631,841.00	6.32
110	601390	中国中铁	629,994.00	6.30

111	002680	长生生物	620,414.80	6.20
112	002517	恺英网络	615,305.26	6.15
113	000601	韶能股份	601,023.00	6.01
114	002426	胜利精密	591,333.00	5.91
115	600196	复星医药	579,883.00	5.80
116	600485	信威集团	576,018.00	5.76
117	002422	科伦药业	567,407.00	5.67
118	300241	瑞丰光电	565,018.19	5.65
119	002555	三七互娱	520,290.00	5.20
120	601009	南京银行	500,416.00	5.00
121	601012	隆基股份	489,889.00	4.90
122	002304	洋河股份	484,974.05	4.85
123	000561	烽火电子	478,417.00	4.78
124	600958	东方证券	476,674.00	4.77
125	000425	徐工机械	454,790.00	4.55
126	600827	百联股份	451,898.00	4.52
127	600350	山东高速	450,622.95	4.51
128	000898	鞍钢股份	445,268.00	4.45
129	603288	海天味业	444,283.00	4.44
130	600674	川投能源	440,188.00	4.40
131	000662	天夏智慧	439,620.00	4.40
132	002142	宁波银行	420,074.00	4.20
133	601339	百隆东方	413,096.00	4.13
134	600340	华夏幸福	413,041.00	4.13
135	600011	华能国际	411,519.00	4.12
136	600276	恒瑞医药	409,799.00	4.10
137	002705	新宝股份	406,238.00	4.06
138	600518	康美药业	403,016.00	4.03
139	600741	华域汽车	398,522.01	3.99
140	002204	大连重工	381,387.00	3.81
141	000069	华侨城A	375,106.00	3.75

142	002507	涪陵榨菜	363,855.92	3.64
143	600566	济川药业	363,269.00	3.63
144	000999	华润三九	362,083.00	3.62
145	000728	国元证券	360,606.50	3.61
146	000883	湖北能源	356,205.99	3.56
147	000989	九芝堂	351,051.00	3.51
148	600233	圆通速递	337,055.00	3.37
149	000156	华数传媒	332,294.00	3.32
150	600236	桂冠电力	331,576.00	3.32
151	002465	海格通信	315,371.50	3.15
152	601669	中国电建	314,124.00	3.14
153	600332	白云山	313,127.00	3.13
154	002182	云海金属	307,837.00	3.08
155	600177	雅戈尔	303,934.00	3.04
156	300182	捷成股份	300,730.00	3.01
157	000963	华东医药	300,512.00	3.00
158	300040	九洲电气	299,050.00	2.99
159	601898	中煤能源	293,734.00	2.94
160	000623	吉林敖东	293,390.00	2.93
161	002475	立讯精密	281,760.00	2.82
162	600690	青岛海尔	275,078.00	2.75
163	600038	中直股份	273,322.00	2.73
164	600482	中国动力	273,142.00	2.73
165	600803	新奥股份	270,923.00	2.71
166	600027	华电国际	269,358.00	2.69
167	601998	中信银行	269,171.00	2.69
168	000686	东北证券	262,588.00	2.63
169	600548	深高速	251,162.50	2.51
170	601229	上海银行	247,617.00	2.48
171	000413	东旭光电	247,145.00	2.47
172	002563	森马服饰	246,916.56	2.47

173	601107	四川成渝	246,773.00	2.47
174	601333	广深铁路	245,794.00	2.46
175	600642	申能股份	245,140.00	2.45
176	002010	传化智联	241,396.00	2.41
177	600376	首开股份	241,063.00	2.41
178	002450	康得新	239,912.00	2.40
179	000729	燕京啤酒	236,993.00	2.37
180	300130	新国都	235,278.00	2.35
181	000625	长安汽车	233,105.00	2.33
182	601992	金隅股份	232,972.00	2.33
183	002714	牧原股份	227,410.00	2.27
184	002152	广电运通	227,342.00	2.27
185	600068	葛洲坝	226,223.00	2.26
186	002146	荣盛发展	219,886.00	2.20
187	600685	中船防务	218,266.00	2.18
188	002309	中利集团	218,194.00	2.18
189	600872	中炬高新	217,743.00	2.18
190	600578	京能电力	217,100.00	2.17
191	002654	万润科技	216,391.00	2.16
192	601788	光大证券	213,410.00	2.13
193	002203	海亮股份	212,793.00	2.13
194	600089	特变电工	210,544.00	2.11
195	300133	华策影视	209,529.00	2.10
196	600429	三元股份	202,573.00	2.03

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	600016	民生银行	1,030,337.91	10.30

2	600837	海通证券	699,225.00	6.99
3	600048	保利地产	677,050.83	6.77
4	601318	中国平安	672,659.00	6.73
5	601668	中国建筑	637,798.00	6.38
6	000776	广发证券	620,304.00	6.20
7	601555	东吴证券	556,151.00	5.56
8	600999	招商证券	554,607.00	5.55
9	601688	华泰证券	540,994.00	5.41
10	601166	兴业银行	501,053.00	5.01
11	002422	科伦药业	482,459.56	4.82
12	601088	中国神华	481,399.00	4.81
13	600104	上汽集团	456,845.00	4.57
14	600674	川投能源	442,258.00	4.42
15	600827	百联股份	431,948.00	4.32
16	000898	鞍钢股份	430,159.00	4.30
17	000069	华侨城A	390,063.90	3.90
18	600011	华能国际	389,849.00	3.90
19	601607	上海医药	388,206.50	3.88
20	600030	中信证券	373,809.00	3.74
21	000895	双汇发展	369,248.48	3.69
22	000999	华润三九	366,503.00	3.66
23	601901	方正证券	361,821.00	3.62
24	000883	湖北能源	359,547.00	3.60
25	600340	华夏幸福	357,795.00	3.58
26	000728	国元证券	353,588.00	3.54
27	600050	中国联通	345,826.00	3.46
28	600741	华域汽车	345,392.00	3.45
29	002304	洋河股份	342,995.82	3.43
30	601800	中国交建	337,203.00	3.37
31	000156	华数传媒	335,859.00	3.36
32	002465	海格通信	335,517.00	3.36

33	600383	金地集团	326,874.00	3.27
34	600170	上海建工	316,679.00	3.17
35	600332	白云山	310,612.00	3.11
36	600000	浦发银行	304,982.72	3.05
37	601898	中煤能源	302,756.00	3.03
38	600803	新奥股份	296,971.00	2.97
39	300182	捷成股份	295,953.91	2.96
40	000623	吉林敖东	295,164.00	2.95
41	000963	华东医药	291,087.00	2.91
42	600690	青岛海尔	287,855.00	2.88
43	600028	中国石化	286,235.00	2.86
44	000063	中兴通讯	285,358.00	2.85
45	300002	神州泰岳	280,852.00	2.81
46	002475	立讯精密	277,391.50	2.77
47	601186	中国铁建	276,283.00	2.76
48	000858	五粮液	275,920.00	2.76
49	600600	青岛啤酒	269,414.00	2.69
50	600061	国投安信	263,566.00	2.64
51	601333	广深铁路	263,476.00	2.63
52	000686	东北证券	263,363.00	2.63
53	600482	中国动力	261,086.00	2.61
54	002736	国信证券	260,046.00	2.60
55	600373	中文传媒	256,174.00	2.56
56	600038	中直股份	253,604.20	2.54
57	000413	东旭光电	251,855.00	2.52
58	000002	万科A	251,444.00	2.51
59	601169	北京银行	249,216.40	2.49
60	600376	首开股份	248,623.00	2.49
61	600900	长江电力	245,182.00	2.45
62	600066	宇通客车	244,854.00	2.45
63	000625	长安汽车	240,918.11	2.41

64	601107	四川成渝	240,591.00	2.41
65	600642	申能股份	240,192.00	2.40
66	002010	传化智联	239,712.00	2.40
67	600027	华电国际	234,948.00	2.35
68	600685	中船防务	232,393.00	2.32
69	600485	信威集团	231,251.00	2.31
70	600098	广州发展	229,239.00	2.29
71	600984	建设机械	226,648.00	2.27
72	000729	燕京啤酒	224,384.00	2.24
73	600203	福日电子	218,315.00	2.18
74	002146	荣盛发展	217,296.00	2.17
75	600068	葛洲坝	217,281.00	2.17
76	002309	中利集团	214,729.00	2.15
77	600585	海螺水泥	212,979.00	2.13
78	601677	明泰铝业	211,688.00	2.12
79	300133	华策影视	210,647.00	2.11
80	601398	工商银行	209,312.00	2.09
81	000333	美的集团	209,161.00	2.09
82	600578	京能电力	207,011.00	2.07
83	002152	广电运通	204,421.00	2.04
84	600998	九州通	200,845.00	2.01

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	260,255,521.07
卖出股票收入（成交）总额	60,409,312.87

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

2016年11月25日，海通证券因两个营业部经营违规受到证监会处罚，没收加罚款金额合计约1.15亿元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，海通证券公司改正态度积极，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。另外，公司2015年营业利润为211亿元，股东权益为1169亿元，1.15亿元罚款对公司利润、股东权益的影响非常有限。该公司作为证券行业龙头之一，经营和财务状况良好，符合我公司股票投资标准。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海通证券进行了投资。

8.12.2

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	3,768.48
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	11,774.86
5	应收申购款	5,491.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,035.10

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 信沪深 300增强 A	80	2,677,949. 96	213,926,23 1.17	99.86%	309,765.72	0.14%
创金合	105	51,666.18	5,000,000.	92.17%	424,948.88	7.83%

信沪深 300增强 C			00			
合计	181	1,213,596. 39	218,926,23 1.17	99.67%	734,714.60	0.33%

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	创金合信沪深300增强A	0.00	0.000000%
	创金合信沪深300增强C	24,996.34	0.460766%
	合计	24,996.34	0.011380%

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	创金合信沪深300增强A	0
	创金合信沪深300增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信沪深300增强A	0
	创金合信沪深300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	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

		额比例			
基金管理人固有资金	10,000,000.00	4.55%	10,000,000.00	4.55%	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	4.55%	10,000,000.00	4.55%	

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强 C
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	209,585,662.43	9,398,900.80
减：本报告期基金总赎回份额	349,665.54	8,973,951.92
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	214,235,996.89	5,424,948.88

§ 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	35,252,486.84	10.99%	25,482.05	8.80%	
光大证券	2	285,412,347.10	89.01%	264,032.78	91.20%	

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	创金合信沪深300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	创金合信沪深300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	公司官网、证券日报	2016-01-22
4	创金合信沪深300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	创金合信沪深300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	创金合信沪深300指数增强型发	公司官网、证券日报	2016-07-20

	起式证券投资基金2016年第2季度报告		
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	创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金（2016年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报	2016-08-14
14	创金合信沪深300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	创金合信沪深300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	创金合信沪深300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	公司官网、证券日报	2016-10-18

	智慧财富为代销机构的公告		
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机构的公告	公司官网、证券日报	2016-10-20
25	创金合信沪深300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	创金合信沪深300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	2016-12-26

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、《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金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

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日