

创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF） 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

§ 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信鼎鑫睿选定开混合
场内简称	创金睿选
基金主代码	501035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月07日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	215,825,032.50份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017-09-18

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济，行业轮动效应与定向增发项目优势的深入研究，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
业绩比较基准	中证定向增发事件指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	梁绍锋	郭明
	联系电话	0755-23838908	010-66105798
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95588
传真		0755-25832571	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2018年01月01日- 2018年06月30日）
本期已实现收益	688,985.23
本期利润	-12,017,205.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0557
本期基金份额净值增长率	-5.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.0374
期末基金资产净值	207,762,159.40
期末基金份额净值	0.9626

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间。

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	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
过去一个月	-4.06%	0.81%	-7.27%	1.31%	3.21%	-0.50%
过去三个月	-4.75%	0.71%	-14.23%	0.99%	9.48%	-0.28%
过去六个月	-5.47%	0.76%	-16.00%	1.02%	10.53%	-0.26%
自基金合同生效起至今	-3.74%	0.57%	-16.85%	0.85%	13.11%	-0.28%

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



§ 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2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11只公募基金。截至2018年6月30日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约147.33亿元。

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		
王一兵	本基金基金经理、固定收益部总监	2017-07-10	-	14年	王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业，作为公司出市代表任海南中商期货交易所红马甲。1997年进入股票市场，经历了各种证券市场的大幅涨跌变化，拥有成熟的投资心态和丰富的投资经验。曾历任第一创业证券固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人。熟悉债券市场和固定收益产品的各种投资技巧，尤其精通近两年发展迅速的信用债，对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。
张荣	本基金基	2017-07-	-	8年	张荣先生，中国国籍，北京大

	金经理	10			学金融学硕士，2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。
曹春林	本基金基金经理	2017-07-07	-	13年	曹春林先生，中国国籍，厦门大学经济学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作，2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作，成功操作了A股市场仅有的两例从二级市场收购并控股上市公司的案例，对上市公司的运作转型和并购重组有深刻的理解，擅长从实业的独特视角去看待资本市场，2010年4月加盟第一创业证券，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。曾获《证券时报》“2013中国最佳财富管理机构评选”最佳资管产品经理；2014年获《中国基金报》“第一届中国最佳基金经理评选”三年期权益类投资最佳投资主办。2014年8月加入创金合基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，现任基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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4次，与该基金发生反向交易的基金为公司量化选股策略的基金，同时该产品采用指数化策略进行投资，组合调仓时与量化选股策略基金发生反向，该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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，外部中美贸易摩擦加剧，对抗升级预期抬升，在过去金融去杠杆的大环境下，企业融资环境转差，流动性压力增大。目前来看，以上因素暂未根本性动摇经济内生动力，企业盈利仍然处于较好的状态，但股市流动性偏好增强、避险情绪抬升，导致股市整体波动性加大；

固收方面，上半年债券收益率整体震荡下行。4月央行宣布定向降准以及6月末央行第二次降低降准的行为，预示着货币政策由中性偏紧向中性偏松转变。市场资金面预期迅速好转，短端收益率快速下行，利率债与高评级表现更好。受到表外融资收缩影响，整体社融增速降低，中低资质企业再融资风险进一步加大，信用利差有所扩张。随后政策面进行相应的微调，对冲表外收缩过快而导致社融快速下滑，市场风险

偏好有所提升，中低评级信用债流动性有所恢复。

本产品将继续维持短久期、中高评级的债券投资策略，降低股票市场波动对产品净值的影响，提升产品流动性，更好的把握后续投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鼎鑫睿选定期混合基金份额净值为0.9626元，本报告期内，基金份额净值增长率为-5.47%，同期业绩比较基准收益率为-16.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向前看，债券市场的总体机会大于风险，下一阶段的优势品种可能是优质信用债。基本面来看，短期经济可能会走弱，但出现失速的风险较小。外部来说，基于政治利益诉求，特朗普政府推行的逆全球化等措施会持续，中美贸易摩擦将不断，但在全球生产一体和全面对抗无益于美国经济的根本逻辑，出口出现大幅下挫的可能性并不大。内部来说，政策仍在推进结构性去杠杆，但考虑到政策的底线思维，目前已经开始针对信用收缩出台相关措施，资管新规的力度已经有所放缓。银行表外收缩并向表内扩张存在资本金、存款等阻碍仍可能不畅，对融资平台的融资约束，房地产棚改货币化安置的渐变，都会构成对未来房地产、基建投资的下行压力。不过，对于货币政策而言，利率水平维持中性偏宽，有利于降低实体融资成本，支持实体经济发展。货币市场利率水平有望维持较为宽松的状态。对信用债而言，政策预防信用过度收缩的措施，提升了优质企业获得融资的能力，信用面总体得到改善，不过弱资质企业获取流动性能力仍可能较差，发生信用风险的可能性未降低。因此，综合来看，年内债市投资选择上将以中短久期为主，而信用债投资需要维持谨慎态度，优选资质较好的发行人。本基金将继续秉承稳健的投资思路，合理配置资产品种和仓位，努力为投资者获取稳健优异的投资回报。

4.6 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、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 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。

4.8 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

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 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

本报告期内，本基金托管人在对创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日

资产：		
银行存款	4,862,856.56	3,064,306.58
结算备付金	5,196,256.60	5,178,800.15
存出保证金	20,883.48	46,680.22
交易性金融资产	296,918,483.27	388,343,892.85
其中：股票投资	106,104,876.47	111,360,612.45
基金投资	-	-
债券投资	190,813,606.80	276,983,280.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	990,096.11	335,821.98
应收利息	1,732,398.79	5,274,423.39
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	309,720,974.81	402,243,925.17
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	98,799,877.50	181,754,028.11
应付证券清算款	2,557,711.38	27,428.46
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	262,933.36	280,450.75
应付托管费	43,822.25	46,741.78
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	115,982.45	45,358.40
应交税费	17,025.51	-
应付利息	28,033.04	161,053.20
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	133,429.92	149,500.00
负债合计	101,958,815.41	182,464,560.70
所有者权益：		
实收基金	215,825,032.50	215,825,032.50
未分配利润	-8,062,873.10	3,954,331.97
所有者权益合计	207,762,159.40	219,779,364.47
负债和所有者权益总计	309,720,974.81	402,243,925.17

注：1. 报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9626元，基金份额总额215,825,032.50份。

2. 本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	-7,105,823.72
1. 利息收入	4,624,585.65
其中：存款利息收入	55,351.90
债券利息收入	4,569,233.75
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	975,780.93

列)	
其中：股票投资收益	54,193.26
基金投资收益	-
债券投资收益	-300,238.44
资产支持证券投资收 益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,221,826.11
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	-12,706,190.30
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	-
减：二、费用	4,911,381.35
1. 管理人报酬	1,643,601.53
2. 托管费	273,933.57
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	390,458.51
5. 利息支出	2,452,063.97
其中：卖出回购金融资产支 出	2,452,063.97
6. 税金及附加	11,672.30
7. 其他费用	139,651.47
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）	-12,017,205.07
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）	-12,017,205.07

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06月30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)	215,825,032.50	3,954,331.97	219,779,364.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,017,205.07	-12,017,205.07
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）	215,825,032.50	-8,062,873.10	207,762,159.40

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)(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[2017]151号《关于准予创金合信

鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)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《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，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215,699,712.96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(2017)第316号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2017年7月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为215,825,033.02份基金份额，其中认购资金利息折合125,320.06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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至18个月(含18个月)后的对应日止，若该日的次日为非工作日，则该封闭期结束日延长至下一工作日的前一日。下一个封闭期为首个开放期结束日的次一工作日起至18个月后的对应日的期间，以此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所(以下简称“上交所”)转让基金份额。

经上交所[2017]324号文审核同意，本基金32,663,801.00份基金份额于2017年9月18日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》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、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、同业存单、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的相关规定)。本基金的业绩比较基准为：中证定向增发事件指数收益率 \times 75%+中债总指数(全价)收益率 \times 25%。

6.4.2 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》、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报

表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末无应付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,643,601.53

其中：支付销售机构的客户维护费	337,614.97
-----------------	------------

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	273,933.57

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,862,856.56	15,638.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2 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	备注
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	123,700	1,083,170.00	924,039.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	38,100	212,049.00	228,600.00	-
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	16,900	88,144.00	81,289.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	6,200	71,920.17	66,960.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	5,100	33,164.00	27,387.00	-
000967	盈峰环境	2018-05-18	重大事项停牌	8.70	2018-07-31	8.01	2,100	17,401.00	18,270.00	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大事项停牌	7.25	2018-08-06	6.53	840	6,529.00	6,090.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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 4,999,877.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1280075	12绵阳投控债	2018-07-02	40.49	125,000	5,061,250.00

合计				125,000	5,061,250.00
----	--	--	--	---------	--------------

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额93,800,000.00元，于2018年7月2日至2018年7月15日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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2018年6月30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139,073,468.12元，第二层次的余额为157,845,015.15元，无属于第三层次的余额（2017年12月31日：第一层次139,984,125.40元，第二层次248,359,767.45元，无属于第三层次的余额）。

(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2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2017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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	106,104,876.47	34.26
	其中：股票	106,104,876.47	34.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	190,813,606.80	61.61
	其中：债券	190,813,606.80	61.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,059,113.16	3.25
8	其他各项资产	2,743,378.38	0.89
9	合计	309,720,974.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	375,754.00	0.18
B	采矿业	4,715,404.60	2.27
C	制造业	38,281,276.78	18.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,484,500.85	1.20
E	建筑业	4,789,046.20	2.31
F	批发和零售业	2,084,736.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,846,585.00	0.89
H	住宿和餐饮业	291,984.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,091,465.00	1.97
J	金融业	39,645,479.90	19.08
K	房地产业	5,911,222.00	2.85
L	租赁和商务服务业	647,194.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	81,289.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	203,886.14	0.10
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	400,572.00	0.19
S	综合	254,481.00	0.12

	合计	106,104,876.47	51.07
--	----	----------------	-------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	167,100	9,788,718.00	4.71
2	600519	贵州茅台	7,500	5,485,950.00	2.64
3	600036	招商银行	161,200	4,262,128.00	2.05
4	601166	兴业银行	199,900	2,878,560.00	1.39
5	600887	伊利股份	97,600	2,723,040.00	1.31
6	600016	民生银行	374,500	2,621,500.00	1.26
7	601328	交通银行	416,200	2,388,988.00	1.15
8	600030	中信证券	127,900	2,119,303.00	1.02
9	601288	农业银行	602,100	2,071,224.00	1.00
10	600104	上汽集团	52,900	1,850,971.00	0.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.cjhxfund.com 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002422	科伦药业	1,710,229.00	0.78
2	601006	大秦铁路	1,619,951.00	0.74
3	000078	海王生物	1,303,694.00	0.59
4	600566	济川药业	1,171,317.00	0.53
5	000488	晨鸣纸业	1,164,077.00	0.53

6	600019	宝钢股份	1,123,142.00	0.51
7	600516	方大炭素	1,119,097.00	0.51
8	600266	北京城建	1,070,767.00	0.49
9	600056	中国医药	1,019,770.00	0.46
10	300287	飞利信	1,009,978.00	0.46
11	000050	深天马A	1,009,685.00	0.46
12	002304	洋河股份	1,002,922.00	0.46
13	600143	金发科技	997,063.00	0.45
14	002078	太阳纸业	969,077.00	0.44
15	000975	银泰资源	947,673.00	0.43
16	000039	中集集团	943,107.00	0.43
17	600201	生物股份	937,336.00	0.43
18	600176	中国巨石	918,727.00	0.42
19	601818	光大银行	915,366.00	0.42
20	600511	国药股份	907,828.00	0.41

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。

7.4.2 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	002589	瑞康医药	1,485,311.90	0.68
2	601006	大秦铁路	1,435,219.00	0.65
3	000667	美好置业	1,250,861.00	0.57
4	601233	桐昆股份	1,219,436.00	0.55
5	600729	重庆百货	1,201,444.00	0.55
6	000513	丽珠集团	1,195,953.00	0.54
7	600062	华润双鹤	1,188,301.00	0.54
8	000732	泰禾集团	1,180,256.00	0.54
9	002503	搜于特	1,094,079.00	0.50
10	300182	捷成股份	1,084,192.00	0.49

11	002179	中航光电	1,083,962.00	0.49
12	600884	杉杉股份	1,062,492.90	0.48
13	601222	林洋能源	1,055,359.48	0.48
14	600056	中国医药	1,036,705.00	0.47
15	600195	中牧股份	1,029,616.00	0.47
16	000902	新洋丰	1,006,999.00	0.46
17	600718	东软集团	1,000,080.00	0.46
18	000050	深天马 A	980,916.00	0.45
19	600755	厦门国贸	978,018.00	0.44
20	002304	洋河股份	973,291.00	0.44

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	162,855,407.73
卖出股票收入（成交）总额	155,033,996.79

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	132,025,000.00	63.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	58,788,606.80	28.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	190,813,606.80	91.84
----	----	----------------	-------

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112328	16曲文01	200,000	19,862,000.00	9.56
2	112402	16华股01	200,000	19,754,000.00	9.51
3	136247	16华综01	200,000	19,744,000.00	9.50
4	132009	17中油EB	200,000	19,472,000.00	9.37
5	113011	光大转债	181,700	18,438,916.00	8.88

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2017年12月29日，三一重工股份有限公司（下称“三一重工”，股票代码：600031）发布关于高级管理人员违规买卖公司股票的公告，主要内容如下：

一、公司副总裁谢志霞先生违反《证券法》第四十七条、《上海证券交易所股票上市规则》第3.1.7条、《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》第十三条的相关规定以及违反了其在《高级管理人员声明及承诺书》中的承诺；

二、三一重工董事会知悉后高度重视，对谢志霞先生违规买卖股票行为进行了严厉的批评教育，并没收本次违规买卖股票所得收益人民币13659元同时处以5000元人民币罚款；

三、公司将要求全体董事、监事和高级管理人员以此为戒，严格遵循相关法规与内部规章制度规定，严格规范买卖公司股票的行为，加强证券账户的管理，坚决杜绝此类事项的再次发生。

本基金投研人员分析认为，三一重工本次高级管理人员违规买卖公司股票行为乃个人行为，同时其交易量较小对于当时市场公允价值并无重大影响，也并未影响三一重工公司整体基本面，维持对于三一重工原有的经营情况判断。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对三一重工，代码600031进行了投资。

7.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 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	20,883.48
2	应收证券清算款	990,096.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,732,398.79

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,743,378.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	18,438,916.00	8.88
2	110032	三一转债	10,300,340.80	4.96
3	110041	蒙电转债	5,670,000.00	2.73

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,048	105,383.32	106,669,610.29	49.42%	109,155,422.21	50.58%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份 额比例(%)
1	赵岩	5,347,730.00	11.54
2	赵本营	4,144,715.00	8.94
3	谢西就	3,955,306.00	8.53

4	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时1号基金	1,396,280.00	3.01
5	未来泽时（上海）资产管理中心（有限合伙）—华夏未来添时三号私	1,320,786.00	2.85
6	朱群江	1,212,300.00	2.62
7	林宇轩	990,999.00	2.14
8	陆鹿	950,935.00	2.05
9	王海旭	938,600.00	2.02
10	东莞首富电子有限公司	869,958.00	1.88

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	49,594.54	0.02%

8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年07月07日)基金份额总额	215,825,033.02
本报告期期初基金份额总额	215,825,032.50
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	215,825,032.50

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 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改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	45,500,578.44	14.38%	32,804.86	15.89%	-
广州证券	2	727,047.62	0.23%	313.57	0.15%	-

太平洋证券	2	113,990,688.18	36.02%	82,206.45	39.83%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	71,796,202.78	22.69%	30,237.22	14.65%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	84,444,170.37	26.68%	60,854.69	29.48%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内新增方正证券、中金公司、江海证券、恒泰证券4家券商的8个交易单元，退租金元证券的2个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	19,949,078.42	28.82%	222,332,000.00	4.26%	-	-	-	-
广州证券	-	-	321,200,000.00	6.16%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	2,469,660,000.00	47.36%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	19,844,245.75	28.67%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	294,000,000.00	5.64%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	562,000,000.00	10.78%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	190,700,000.00	3.66%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

银河证券	29,415,301.70	42.50%	1,154,400.00	22.14%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101 - 20180630	90,007,100.00	0.00	0.00	90,007,100.00	41.70%

产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

1、大额申购风险

在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；

(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；

(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份

额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日