

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

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。

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 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| §6 半年度财务会计报告(未经审计) | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| §7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 38 |
| 7.3 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 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 49 |
| 7.7 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 50 |
| §8 基金份额持有人信息 | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 51 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 52 |

| | |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §10 重大事件揭示..... | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 57 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 60 |
| §12 备查文件目录..... | 60 |
| 12.1 备查文件目录..... | 60 |
| 12.2 存放地点..... | 60 |
| 12.3 查阅方式..... | 60 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF） |
| 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 | |
| 注册地址 | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) | 北京市西城区复兴门内大街55号 | |
| 办公地址 | 深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 | |
| 邮政编码 | 518000 | 100140 | |
| 法定代表人 | 刘学民 | 易会满 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报、中国证券报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|-----------------------|
| 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 |
| 本期加权平均净值利润率 | -5.44% |
| 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） |
| 期末可供分配利润 | -8,062,873.10 |
| 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 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2018年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率 | -3.74% |

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。

4. 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日正式注册成立，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 金经理 | 2017-07- 10 | - | 8年 | 张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。 |
| 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>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月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，现任基金经理。</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，中低平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合规守信、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 | 附注号 | 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 | 6.4.7.1 | 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 | 6.4.7.2 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |

| | | | |
|-----------------|--------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 990,096.11 | 335,821.98 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 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 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 309,720,974.81 | 402,243,925.17 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 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 | 6.4.7.7 | 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 | 6.4.7.8 | 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 | 6.4.7.9 | 215,825,032.50 | 215,825,032.50 |
| 未分配利润 | 6.4.7.1 0 | -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 | 附注号 | 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 | 6.4.7.11 | 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“-”填列） | | 975,780.93 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 54,193.26 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -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 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,221,826.11 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -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） | 6.4.7.17 | - |
| 减：二、费用 | | 4,911,381.35 |

| | | |
|----------------------------|------------|----------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,643,601.53 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 273,933.57 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 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 | 6.4.7.19 | 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×75%+中债总指数（全价）收益率×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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 4,862,856.56 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |

| | |
|-----------|--------------|
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 4,862,856.56 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2018年06月30日 | | |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 113,395,142.21 | 106,104,876.47 | -7,290,265.74 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 155,606,860.52 | 152,855,106.80 |
| | 银行间市场 | 38,658,318.33 | 37,958,500.00 |
| | 合计 | 194,265,178.85 | 190,813,606.80 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 307,660,321.06 | 296,918,483.27 | -10,741,837.79 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 884.05 |
| 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 | 2,338.30 |
| 应收债券利息 | 1,729,167.04 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 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 | 9.40 |
| 合计 | 1,732,398.79 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 111,386.23 |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,596.22 |
| 合计 | 115,982.45 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 133,429.92 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 133,429.92 |
|----|------------|

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2018年01月01日至2018年06月30日 | |
|---------------|---------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 215,825,032.50 | 215,825,032.50 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 215,825,032.50 | 215,825,032.50 |

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 1,989,979.46 | 1,964,352.51 | 3,954,331.97 |
| 本期利润 | 688,985.23 | -12,706,190.30 | -12,017,205.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,678,964.69 | -10,741,837.79 | -8,062,873.10 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入 | 15,638.61 |
| 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 | 39,475.75 |

| | |
|----|-----------|
| 其他 | 237.54 |
| 合计 | 55,351.90 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 155,033,996.79 |
| 减：卖出股票成本总额 | 154,979,803.53 |
| 买卖股票差价收入 | 54,193.26 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -300,238.44 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -300,238.44 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 111,823,760.55 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 107,853,683.15 |
| 减：应收利息总额 | 4,270,315.84 |
| 买卖债券差价收入 | -300,238.44 |

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,221,826.11 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,221,826.11 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -12,706,190.30 |
| ——股票投资 | -13,131,340.18 |
| ——债券投资 | 425,149.88 |
| ——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 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -12,706,190.30 |

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 389,883.51 |
| 银行间市场交易费用 | 575.00 |
| 合计 | 390,458.51 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-------|-------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 99,177.14 |
| 汇划手续费 | 1,721.55 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 139,651.47 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |

| | |
|------------------------|-----------------|
| 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 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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。

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 | |
|--------------|-------------------------|-----------|
| | 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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 | - |

6.4.12.2 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 | 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- | 重大事项 | 6.00 | - | - | 38,100 | 212,049.00 | 228,600.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|--------|-------|------------|------|--------|-----------|-----------|---|
| | | 16 | 停牌 | | | | | | | |
| 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 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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 |

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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工商银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为期限一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2018年06月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 87,941,266.00 | 58,074,029.00 |
| AAA以下 | 102,872,340.80 | 218,909,251.40 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 190,813,606.80 | 276,983,280.40 |

未评级债券为期限一年以上的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

6.4.13.3 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证券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上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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6.4.12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。

于2018年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有98,799,877.50元将在1个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内本基金尚处于封闭期，封闭期内不办理申购与赎回业务，因此综合上述各项流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内不存在未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2018年06月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------|---------------|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,862,856.56 | - | - | - | 4,862,856.56 |
| 结算备付金 | 5,196,256.60 | - | - | - | 5,196,256.60 |
| 存出保证金 | 20,883.48 | - | - | - | 20,883.48 |
| 交易性金融资产 | 37,505,500.00 | 147,638,106.80 | 5,670,000.00 | 106,104,876.47 | 296,918,483.27 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 990,096.11 | 990,096.11 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,732,398.79 | 1,732,398.79 |
| 资产总计 | 47,585,496.64 | 147,638,106.80 | 5,670,000.00 | 108,827,371.37 | 309,720,974.81 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|-----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | 98,799,877.50 | - | - | - | 98,799,877.50 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,557,711.38 | 2,557,711.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 262,933.36 | 262,933.36 |
| 应付托管费 | - | - | - | 43,822.25 | 43,822.25 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 115,982.45 | 115,982.45 |
| 应交税费 | - | - | - | 17,025.51 | 17,025.51 |
| 应付利息 | - | - | - | 28,033.04 | 28,033.04 |
| 其他负债 | - | - | - | 133,429.92 | 133,429.92 |
| 负债总计 | 98,799,877.50 | - | - | 3,158,937.91 | 101,958,815.41 |
| 利率敏感度缺口 | -51,214,380.86 | 147,638,106.80 | 5,670,000.00 | 105,668,433.46 | 207,762,159.40 |
| 上年度末2017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 | 3,064,306.58 | - | - | - | 3,064,306.58 |
| 结算备付金 | 5,178,800.15 | - | - | - | 5,178,800.15 |
| 存出保证金 | 46,680.22 | - | - | - | 46,680.22 |
| 交易性金融资产 | 52,975,900.00 | 205,043,351.40 | 18,964,029.00 | 111,360,612.45 | 388,343,892.85 |

| | | | | | |
|-------------------|-----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 应收证 券清算 款 | - | - | - | 335,821.98 | 335,821.98 |
| 应收利 息 | - | - | - | 5,274,423.39 | 5,274,423.39 |
| 资产总 计 | 61,265,686.95 | 205,043,351.40 | 18,964,029.00 | 116,970,857.82 | 402,243,925.17 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回 购金融 资产款 | 181,754,028.11 | - | - | - | 181,754,028.11 |
| 应付证 券清算 款 | - | - | - | 27,428.46 | 27,428.46 |
| 应付管 理人报 酬 | - | - | - | 280,450.75 | 280,450.75 |
| 应付托 管费 | - | - | - | 46,741.78 | 46,741.78 |
| 应付交 易费用 | - | - | - | 45,358.40 | 45,358.40 |
| 应付利 息 | - | - | - | 161,053.20 | 161,053.20 |
| 其他负 债 | - | - | - | 149,500.00 | 149,500.00 |
| 负债总 计 | 181,754,028.11 | - | - | 710,532.59 | 182,464,560.70 |
| 利率敏 感度缺 口 | -120,488,341.16 | 205,043,351.40 | 18,964,029.00 | 116,260,325.23 | 219,779,364.47 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------|---------------------------------|------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 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 |

| | | | |
|--|-------------|-------------|-------------|
| | | 2018年06月30日 | 2017年12月31日 |
| | 市场利率上升25个基点 | -291,341.33 | -548,478.86 |
| | 市场利率下降25个基点 | 292,786.00 | 551,361.55 |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年06月30日 | | 上年度末 2017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 | 106,104,876.47 | 51.07 | 111,360,612.45 | 50.67 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 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 | 106,104,876.47 | 51.07 | 111,360,612.45 | 50.67 |

6.4.13.4.3.2 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 2018年06月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
| | 比较基准上涨5%资产净值变动 | 3,830,904.82 | 2,451,195.76 |
| 比较基准下降5%资产净值变动 | -3,830,904.82 | -2,451,195.76 | |

6.4.14 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

| 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(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 |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 186,800 | 1,785,808.00 | 0.86 |
| 12 | 601668 | 中国建筑 | 325,720 | 1,778,431.20 | 0.86 |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 50,100 | 1,595,685.00 | 0.77 |
| 14 | 601169 | 北京银行 | 234,600 | 1,414,638.00 | 0.68 |
| 15 | 600048 | 保利地产 | 104,000 | 1,268,800.00 | 0.61 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 129,800 | 1,229,206.00 | 0.59 |
| 17 | 600028 | 中国石化 | 179,000 | 1,161,710.00 | 0.56 |
| 18 | 601988 | 中国银行 | 317,900 | 1,147,619.00 | 0.55 |
| 19 | 600518 | 康美药业 | 49,900 | 1,141,712.00 | 0.55 |
| 20 | 600019 | 宝钢股份 | 138,300 | 1,077,357.00 | 0.52 |
| 21 | 002422 | 科伦药业 | 32,600 | 1,046,460.00 | 0.50 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 22 | 600516 | 方大炭素 | 41,000 | 999,580.00 | 0.48 |
| 23 | 601766 | 中国中车 | 125,400 | 965,580.00 | 0.46 |
| 24 | 601390 | 中国中铁 | 123,700 | 924,039.00 | 0.44 |
| 25 | 601211 | 国泰君安 | 62,200 | 916,828.00 | 0.44 |
| 26 | 601818 | 光大银行 | 250,100 | 915,366.00 | 0.44 |
| 27 | 601006 | 大秦铁路 | 98,000 | 804,580.00 | 0.39 |
| 28 | 601688 | 华泰证券 | 53,500 | 800,895.00 | 0.39 |
| 29 | 600201 | 生物股份 | 44,980 | 768,708.20 | 0.37 |
| 30 | 601857 | 中国石油 | 96,800 | 746,328.00 | 0.36 |
| 31 | 600309 | 万华化学 | 15,900 | 722,178.00 | 0.35 |
| 32 | 600919 | 江苏银行 | 112,300 | 719,843.00 | 0.35 |
| 33 | 600050 | 中国联通 | 145,400 | 715,368.00 | 0.34 |
| 34 | 600256 | 广汇能源 | 160,400 | 656,036.00 | 0.32 |
| 35 | 000786 | 北新建材 | 34,700 | 642,991.00 | 0.31 |
| 36 | 002038 | 双鹭药业 | 16,100 | 611,639.00 | 0.29 |
| 37 | 601186 | 中国铁建 | 70,900 | 611,158.00 | 0.29 |
| 38 | 002078 | 太阳纸业 | 63,000 | 610,470.00 | 0.29 |
| 39 | 601989 | 中国重工 | 149,100 | 602,364.00 | 0.29 |
| 40 | 601628 | 中国人寿 | 26,300 | 592,276.00 | 0.29 |
| 41 | 601088 | 中国神华 | 29,200 | 582,248.00 | 0.28 |
| 42 | 000656 | 金科股份 | 108,900 | 522,720.00 | 0.25 |
| 43 | 600999 | 招商证券 | 38,100 | 521,208.00 | 0.25 |
| 44 | 002311 | 海大集团 | 24,700 | 521,170.00 | 0.25 |
| 45 | 600079 | 人福医药 | 39,300 | 519,546.00 | 0.25 |
| 46 | 601336 | 新华保险 | 12,000 | 514,560.00 | 0.25 |
| 47 | 600029 | 南方航空 | 60,400 | 510,380.00 | 0.25 |
| 48 | 000690 | 宝新能源 | 72,100 | 501,816.00 | 0.24 |
| 49 | 600566 | 济川药业 | 10,100 | 486,719.00 | 0.23 |
| 50 | 000488 | 晨鸣纸业 | 37,300 | 481,916.00 | 0.23 |
| 51 | 000581 | 威孚高科 | 21,100 | 466,521.00 | 0.22 |
| 52 | 000997 | 新大陆 | 29,600 | 466,200.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 53 | 600600 | 青岛啤酒 | 10,600 | 464,598.00 | 0.22 |
| 54 | 600958 | 东方证券 | 50,800 | 463,804.00 | 0.22 |
| 55 | 600340 | 华夏幸福 | 18,000 | 463,500.00 | 0.22 |
| 56 | 600160 | 巨化股份 | 61,950 | 453,474.00 | 0.22 |
| 57 | 002195 | 二三四五 | 105,300 | 450,684.00 | 0.22 |
| 58 | 600438 | 通威股份 | 64,900 | 447,810.00 | 0.22 |
| 59 | 000596 | 古井贡酒 | 5,000 | 443,900.00 | 0.21 |
| 60 | 000975 | 银泰资源 | 42,240 | 428,313.60 | 0.21 |
| 61 | 000732 | 泰禾集团 | 21,700 | 422,065.00 | 0.20 |
| 62 | 601985 | 中国核电 | 73,300 | 414,145.00 | 0.20 |
| 63 | 600572 | 康恩贝 | 57,600 | 412,992.00 | 0.20 |
| 64 | 600056 | 中国医药 | 22,500 | 411,075.00 | 0.20 |
| 65 | 002373 | 千方科技 | 31,500 | 411,075.00 | 0.20 |
| 66 | 600655 | 豫园股份 | 43,000 | 406,350.00 | 0.20 |
| 67 | 600176 | 中国巨石 | 39,440 | 403,471.20 | 0.19 |
| 68 | 000528 | 柳工 | 37,200 | 398,412.00 | 0.19 |
| 69 | 601669 | 中国电建 | 73,000 | 391,280.00 | 0.19 |
| 70 | 600240 | 华业资本 | 53,300 | 390,689.00 | 0.19 |
| 71 | 600266 | 北京城建 | 41,500 | 390,100.00 | 0.19 |
| 72 | 002028 | 思源电气 | 23,100 | 387,849.00 | 0.19 |
| 73 | 002640 | 跨境通 | 25,600 | 384,512.00 | 0.19 |
| 74 | 600111 | 北方稀土 | 33,400 | 380,092.00 | 0.18 |
| 75 | 600143 | 金发科技 | 72,800 | 380,016.00 | 0.18 |
| 76 | 000778 | 新兴铸管 | 88,100 | 377,068.00 | 0.18 |
| 77 | 002244 | 滨江集团 | 70,500 | 366,600.00 | 0.18 |
| 78 | 002221 | 东华能源 | 37,000 | 361,490.00 | 0.17 |
| 79 | 002440 | 闰土股份 | 30,600 | 357,714.00 | 0.17 |
| 80 | 600606 | 绿地控股 | 54,100 | 353,814.00 | 0.17 |
| 81 | 600978 | 宜华生活 | 51,800 | 353,794.00 | 0.17 |
| 82 | 000078 | 海王生物 | 72,500 | 348,725.00 | 0.17 |
| 83 | 000547 | 航天发展 | 44,500 | 347,545.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 84 | 300287 | 飞利信 | 47,800 | 343,682.00 | 0.17 |
| 85 | 300113 | 顺网科技 | 19,300 | 336,013.00 | 0.16 |
| 86 | 000598 | 兴蓉环境 | 81,400 | 330,484.00 | 0.16 |
| 87 | 600466 | 蓝光发展 | 53,200 | 329,840.00 | 0.16 |
| 88 | 002004 | 华邦健康 | 63,700 | 323,596.00 | 0.16 |
| 89 | 002152 | 广电运通 | 54,500 | 320,460.00 | 0.15 |
| 90 | 600863 | 内蒙华电 | 135,200 | 306,904.00 | 0.15 |
| 91 | 002603 | 以岭药业 | 21,900 | 306,162.00 | 0.15 |
| 92 | 600547 | 山东黄金 | 12,700 | 303,784.00 | 0.15 |
| 93 | 600823 | 世茂股份 | 71,800 | 300,124.00 | 0.14 |
| 94 | 600881 | 亚泰集团 | 78,700 | 293,551.00 | 0.14 |
| 95 | 000031 | 中粮地产 | 50,700 | 293,046.00 | 0.14 |
| 96 | 002266 | 浙富控股 | 78,000 | 292,500.00 | 0.14 |
| 97 | 600754 | 锦江股份 | 7,900 | 291,984.00 | 0.14 |
| 98 | 600835 | 上海机电 | 15,400 | 290,444.00 | 0.14 |
| 99 | 002400 | 省广集团 | 87,800 | 283,594.00 | 0.14 |
| 100 | 600664 | 哈药股份 | 71,400 | 283,458.00 | 0.14 |
| 101 | 002056 | 横店东磁 | 40,300 | 282,503.00 | 0.14 |
| 102 | 000027 | 深圳能源 | 57,100 | 282,074.00 | 0.14 |
| 103 | 002233 | 塔牌集团 | 23,900 | 273,416.00 | 0.13 |
| 104 | 603993 | 洛阳钼业 | 43,200 | 271,728.00 | 0.13 |
| 105 | 601800 | 中国交建 | 23,800 | 271,082.00 | 0.13 |
| 106 | 000758 | 中色股份 | 59,300 | 266,850.00 | 0.13 |
| 107 | 600557 | 康缘药业 | 21,600 | 266,760.00 | 0.13 |
| 108 | 000012 | 南玻A | 53,860 | 266,607.00 | 0.13 |
| 109 | 600098 | 广州发展 | 41,000 | 264,450.00 | 0.13 |
| 110 | 601717 | 郑煤机 | 45,100 | 262,031.00 | 0.13 |
| 111 | 000021 | 深科技 | 37,000 | 252,340.00 | 0.12 |
| 112 | 601311 | 骆驼股份 | 21,800 | 250,046.00 | 0.12 |
| 113 | 000400 | 许继电气 | 31,900 | 249,139.00 | 0.12 |
| 114 | 002544 | 杰赛科技 | 18,100 | 247,789.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 115 | 601928 | 凤凰传媒 | 40,100 | 243,808.00 | 0.12 |
| 116 | 600582 | 天地科技 | 65,800 | 241,486.00 | 0.12 |
| 117 | 300297 | 蓝盾股份 | 29,000 | 235,190.00 | 0.11 |
| 118 | 002463 | 沪电股份 | 61,300 | 229,262.00 | 0.11 |
| 119 | 000825 | 太钢不锈 | 38,100 | 228,600.00 | 0.11 |
| 120 | 600565 | 迪马股份 | 77,300 | 228,035.00 | 0.11 |
| 121 | 000592 | 平潭发展 | 79,700 | 226,348.00 | 0.11 |
| 122 | 600578 | 京能电力 | 72,400 | 225,888.00 | 0.11 |
| 123 | 600317 | 营口港 | 96,900 | 218,994.00 | 0.11 |
| 124 | 002375 | 亚厦股份 | 40,900 | 218,406.00 | 0.11 |
| 125 | 000552 | 靖远煤电 | 66,600 | 217,782.00 | 0.10 |
| 126 | 002063 | 远光软件 | 25,700 | 217,422.00 | 0.10 |
| 127 | 000969 | 安泰科技 | 33,900 | 211,875.00 | 0.10 |
| 128 | 600151 | 航天机电 | 52,000 | 211,120.00 | 0.10 |
| 129 | 000541 | 佛山照明 | 35,210 | 210,907.90 | 0.10 |
| 130 | 002073 | 软控股份 | 36,500 | 209,875.00 | 0.10 |
| 131 | 600284 | 浦东建设 | 43,000 | 209,840.00 | 0.10 |
| 132 | 600458 | 时代新材 | 28,100 | 206,816.00 | 0.10 |
| 133 | 002251 | 步步高 | 18,100 | 205,978.00 | 0.10 |
| 134 | 002276 | 万马股份 | 35,100 | 204,984.00 | 0.10 |
| 135 | 002707 | 众信旅游 | 21,200 | 203,520.00 | 0.10 |
| 136 | 601066 | 中信建投 | 18,690 | 201,104.40 | 0.10 |
| 137 | 001696 | 宗申动力 | 40,400 | 197,960.00 | 0.10 |
| 138 | 601229 | 上海银行 | 12,400 | 195,424.00 | 0.09 |
| 139 | 002663 | 普邦股份 | 63,900 | 189,783.00 | 0.09 |
| 140 | 002588 | 史丹利 | 36,000 | 186,480.00 | 0.09 |
| 141 | 002261 | 拓维信息 | 40,400 | 185,840.00 | 0.09 |
| 142 | 600748 | 上实发展 | 35,800 | 180,432.00 | 0.09 |
| 143 | 000536 | 华映科技 | 46,500 | 127,875.00 | 0.06 |
| 144 | 601990 | 南京证券 | 10,230 | 110,995.50 | 0.05 |
| 145 | 603587 | 地素时尚 | 2,442 | 100,879.02 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 146 | 000881 | 中广核技 | 9,700 | 96,903.00 | 0.05 |
| 147 | 300059 | 东方财富 | 6,900 | 90,942.00 | 0.04 |
| 148 | 000425 | 徐工机械 | 21,400 | 90,736.00 | 0.04 |
| 149 | 000902 | 新洋丰 | 9,700 | 89,240.00 | 0.04 |
| 150 | 600688 | 上海石化 | 15,300 | 87,057.00 | 0.04 |
| 151 | 000157 | 中联重科 | 21,100 | 86,721.00 | 0.04 |
| 152 | 601965 | 中国汽研 | 10,200 | 85,476.00 | 0.04 |
| 153 | 601881 | 中国银河 | 10,500 | 85,365.00 | 0.04 |
| 154 | 600398 | 海澜之家 | 6,700 | 85,358.00 | 0.04 |
| 155 | 300400 | 劲拓股份 | 6,300 | 85,113.00 | 0.04 |
| 156 | 002203 | 海亮股份 | 10,500 | 85,050.00 | 0.04 |
| 157 | 601009 | 南京银行 | 11,000 | 85,030.00 | 0.04 |
| 158 | 600185 | 格力地产 | 15,500 | 84,165.00 | 0.04 |
| 159 | 600491 | 龙元建设 | 12,000 | 83,880.00 | 0.04 |
| 160 | 002061 | 浙江交科 | 8,000 | 83,760.00 | 0.04 |
| 161 | 601888 | 中国国旅 | 1,300 | 83,733.00 | 0.04 |
| 162 | 000858 | 五粮液 | 1,100 | 83,600.00 | 0.04 |
| 163 | 002626 | 金达威 | 4,800 | 83,280.00 | 0.04 |
| 164 | 002142 | 宁波银行 | 5,100 | 83,079.00 | 0.04 |
| 165 | 601333 | 广深铁路 | 19,500 | 82,875.00 | 0.04 |
| 166 | 002360 | 同德化工 | 15,200 | 82,840.00 | 0.04 |
| 167 | 601369 | 陕鼓动力 | 12,900 | 82,560.00 | 0.04 |
| 168 | 300305 | 裕兴股份 | 13,600 | 82,280.00 | 0.04 |
| 169 | 600676 | 交运股份 | 16,500 | 82,005.00 | 0.04 |
| 170 | 000631 | 顺发恒业 | 23,900 | 81,977.00 | 0.04 |
| 171 | 600705 | 中航资本 | 17,500 | 81,725.00 | 0.04 |
| 172 | 600805 | 悦达投资 | 16,000 | 81,600.00 | 0.04 |
| 173 | 002478 | 常宝股份 | 18,200 | 81,536.00 | 0.04 |
| 174 | 300498 | 温氏股份 | 3,700 | 81,474.00 | 0.04 |
| 175 | 300217 | 东方电热 | 33,900 | 81,360.00 | 0.04 |
| 176 | 300008 | 天海防务 | 16,900 | 81,289.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 177 | 601330 | 绿色动力 | 4,971 | 81,226.14 | 0.04 |
| 178 | 002298 | 中电兴发 | 11,500 | 81,190.00 | 0.04 |
| 179 | 000767 | 漳泽电力 | 31,800 | 81,090.00 | 0.04 |
| 180 | 000069 | 华侨城A | 11,200 | 80,976.00 | 0.04 |
| 181 | 000719 | 中原传媒 | 12,100 | 80,949.00 | 0.04 |
| 182 | 002546 | 新联电子 | 21,700 | 80,941.00 | 0.04 |
| 183 | 300349 | 金卡智能 | 4,200 | 80,808.00 | 0.04 |
| 184 | 300414 | 中光防雷 | 4,800 | 80,736.00 | 0.04 |
| 185 | 600741 | 华域汽车 | 3,400 | 80,648.00 | 0.04 |
| 186 | 000780 | 平庄能源 | 21,500 | 80,625.00 | 0.04 |
| 187 | 002148 | 北纬科技 | 13,900 | 80,620.00 | 0.04 |
| 188 | 002391 | 长青股份 | 6,300 | 80,514.00 | 0.04 |
| 189 | 002495 | 佳隆股份 | 27,100 | 79,674.00 | 0.04 |
| 190 | 002006 | 精功科技 | 14,500 | 79,605.00 | 0.04 |
| 191 | 601633 | 长城汽车 | 8,100 | 79,542.00 | 0.04 |
| 192 | 002533 | 金杯电工 | 16,400 | 79,540.00 | 0.04 |
| 193 | 600602 | 云赛智联 | 13,700 | 79,460.00 | 0.04 |
| 194 | 000965 | 天保基建 | 17,900 | 79,118.00 | 0.04 |
| 195 | 002017 | 东信和平 | 12,700 | 78,867.00 | 0.04 |
| 196 | 002561 | 徐家汇 | 8,700 | 78,735.00 | 0.04 |
| 197 | 300303 | 聚飞光电 | 28,700 | 78,638.00 | 0.04 |
| 198 | 603100 | 川仪股份 | 9,300 | 78,585.00 | 0.04 |
| 199 | 601107 | 四川成渝 | 22,900 | 78,547.00 | 0.04 |
| 200 | 002406 | 远东传动 | 14,300 | 78,507.00 | 0.04 |
| 201 | 000756 | 新华制药 | 7,600 | 78,432.00 | 0.04 |
| 202 | 002187 | 广百股份 | 9,500 | 78,280.00 | 0.04 |
| 203 | 002318 | 久立特材 | 13,000 | 78,260.00 | 0.04 |
| 204 | 600706 | 曲江文旅 | 6,900 | 77,970.00 | 0.04 |
| 205 | 002671 | 龙泉股份 | 17,400 | 77,604.00 | 0.04 |
| 206 | 601010 | 文峰股份 | 25,600 | 77,568.00 | 0.04 |
| 207 | 002403 | 爱仕达 | 8,600 | 77,486.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 208 | 600420 | 现代制药 | 7,400 | 76,960.00 | 0.04 |
| 209 | 002501 | 利源精制 | 12,400 | 76,880.00 | 0.04 |
| 210 | 600775 | 南京熊猫 | 13,500 | 76,410.00 | 0.04 |
| 211 | 600057 | 厦门象屿 | 15,300 | 76,347.00 | 0.04 |
| 212 | 000880 | 潍柴重机 | 9,900 | 76,131.00 | 0.04 |
| 213 | 600603 | 广汇物流 | 18,900 | 75,978.00 | 0.04 |
| 214 | 600373 | 中文传媒 | 5,900 | 75,815.00 | 0.04 |
| 215 | 300204 | 舒泰神 | 7,000 | 75,740.00 | 0.04 |
| 216 | 600831 | 广电网络 | 12,500 | 75,250.00 | 0.04 |
| 217 | 600376 | 首开股份 | 10,700 | 75,221.00 | 0.04 |
| 218 | 002331 | 皖通科技 | 10,100 | 74,740.00 | 0.04 |
| 219 | 002470 | 金正大 | 10,800 | 74,304.00 | 0.04 |
| 220 | 600781 | 辅仁药业 | 4,700 | 73,790.00 | 0.04 |
| 221 | 002543 | 万和电气 | 3,800 | 73,416.00 | 0.04 |
| 222 | 300437 | 清水源 | 4,400 | 73,128.00 | 0.04 |
| 223 | 600828 | 茂业商业 | 14,300 | 72,930.00 | 0.04 |
| 224 | 300320 | 海达股份 | 13,400 | 71,422.00 | 0.03 |
| 225 | 600829 | 人民同泰 | 9,800 | 70,168.00 | 0.03 |
| 226 | 000548 | 湖南投资 | 15,800 | 69,204.00 | 0.03 |
| 227 | 600257 | 大湖股份 | 14,800 | 67,932.00 | 0.03 |
| 228 | 300118 | 东方日升 | 6,200 | 66,960.00 | 0.03 |
| 229 | 600299 | 安迪苏 | 5,400 | 62,856.00 | 0.03 |
| 230 | 601339 | 百隆东方 | 10,800 | 62,100.00 | 0.03 |
| 231 | 601878 | 浙商证券 | 6,500 | 54,600.00 | 0.03 |
| 232 | 603650 | 彤程新材 | 2,376 | 50,988.96 | 0.02 |
| 233 | 603693 | 江苏新能 | 5,384 | 48,456.00 | 0.02 |
| 234 | 300190 | 维尔利 | 8,200 | 44,690.00 | 0.02 |
| 235 | 002448 | 中原内配 | 5,800 | 40,426.00 | 0.02 |
| 236 | 000063 | 中兴通讯 | 2,800 | 36,484.00 | 0.02 |
| 237 | 300197 | 铁汉生态 | 5,100 | 27,387.00 | 0.01 |
| 238 | 603706 | 东方环宇 | 1,765 | 23,103.85 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 239 | 000967 | 盈峰环境 | 2,100 | 18,270.00 | 0.01 |
| 240 | 603105 | 芯能科技 | 3,410 | 16,470.30 | 0.01 |
| 241 | 600742 | 一汽富维 | 960 | 11,740.80 | 0.01 |
| 242 | 600331 | 宏达股份 | 4,400 | 11,396.00 | 0.01 |
| 243 | 600535 | 天士力 | 320 | 8,262.40 | 0.00 |
| 244 | 000669 | 金鸿控股 | 840 | 6,090.00 | 0.00 |
| 245 | 002390 | 信邦制药 | 100 | 732.00 | 0.00 |

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. | 8.88 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|----|--|
| | | | | 00 | |
|--|--|--|--|----|--|

7.7 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。

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 | 户均持有的基金份 | 持有人结构 |
|----|----------|-------|
|----|----------|-------|

| 人户数 (户) | 额 | 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、基金投资和研发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 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|----|------|-----|-----------|-----|----|
| | | 成交金额 | 占当期 | 佣金 | 占当期 | |
| | | | | | | |

| | 单元数量 | | 股票成交总额的比例 | | 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 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 宏源 | | | | | | |
| 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 | 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% | 1,154,400,000.00 | 22.14% | - | - | - | - |
| 中信证 券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证 券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-01-02 |
| 2 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-01-19 |

| | | | |
|----|--|-----------------|------------|
| | 2017年第4季度报告 | | |
| 3 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）（2018年第1号）招募说明书（更新） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-02-14 |
| 4 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要（2018年第1号） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-02-14 |
| 5 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-02-22 |
| 6 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）（2018年第1号）招募说明书（更新）（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-28 |
| 7 | 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（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-28 |
| 8 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-28 |
| 9 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-28 |
| 10 | 创金合信基金管理有限公司关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）修订基金合同、托管协议部分条款的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-28 |
| 11 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF） | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-31 |

| | | | |
|----|--|-----------------|------------|
| | 2017年年度报告 | | |
| 12 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）2017年年度报告摘要 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-03-31 |
| 13 | 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）2018年第1季度报告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-04-19 |
| 14 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-04-27 |
| 15 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与第一创业证券费率优惠活动的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-05-24 |
| 16 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-06-15 |
| 17 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报、中国证券报 | 2018-06-21 |

§ 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 | | | | | | | |
| <p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> | | | | | | | |

2、大额赎回风险

- (1) 若本基金在短期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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《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》；
- 2、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 3、创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）2018年半年度报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日