
创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
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	77
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	77
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	77
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	77
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12 投资组合报告附注	78
§8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	80
§9 开放式基金份额变动	81
§10 重大事件揭示	81
10.1 基金份额持有人大会决议	81
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	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
10.8 其他重大事件	83
§11 影响投资者决策的其他重要信息	86
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	86
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§12 备查文件目录	86
12.1 备查文件目录	87
12.2 存放地点	87
12.3 查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证500增强	
基金主代码	002311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月31日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	375,345,967.94份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
下属分级基金的交易代码	002311	002316
报告期末下属分级基金的份额总额	264,253,794.10份	111,092,173.84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。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本

	基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。
--	---

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201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	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15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)	
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
本期已实现收益	-21,615,304.93	-10,232,282.82
本期利润	-29,790,531.28	-12,635,905.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1261	-0.1691
本期加权平均净值利润率	-12.46%	-16.75%
本期基金份额净值增长率	-11.54%	-11.48%
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	-23,104,715.28	-9,122,052.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0874	-0.0821
期末基金资产净值	241,149,078.82	101,970,121.28
期末基金份额净值	0.9126	0.9179
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	-8.74%	-8.21%

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

创金合信中证500增强A

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	-8.62%	1.79%	-8.86%	1.77%	0.24%	0.02%
过去三 个月	-11.38%	1.33%	-13.95%	1.31%	2.57%	0.02%
过去六 个月	-11.54%	1.32%	-15.69%	1.37%	4.15%	-0.05%
过去一 年	-4.46%	1.09%	-14.16%	1.16%	9.70%	-0.07%
自基金 合同生 效起至 今	-8.74%	1.37%	-30.89%	1.41%	22.15%	-0.04%

创金合信中证500增强C

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	-8.58%	1.79%	-8.86%	1.77%	0.28%	0.02%
过去三 个月	-11.35%	1.33%	-13.95%	1.31%	2.60%	0.02%
过去六 个月	-11.48%	1.32%	-15.69%	1.37%	4.21%	-0.05%
过去一 年	-4.39%	1.09%	-14.16%	1.16%	9.77%	-0.07%
自基金 合同生 效起至	-8.21%	1.37%	-30.89%	1.41%	22.68%	-0.04%

今						
---	--	--	--	--	--	--

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		
程志田	本基金基金经理、量化投资部总监	2015-12-31	-	11年	程志田先生，中国国籍，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。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。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。
庞世恩	本基金基金经理	2016-01-08	-	6年	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。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。

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30次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股

票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，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

回顾2018年上半年，我们严格依据量化选股模型进行投资，并严格进行风险管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证500增强A基金份额净值为0.9126元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.54%，同期业绩比较基准收益率为-15.69%；截至报告期末创金合信中证500增强C基金份额净值为0.9179元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.48%，同期业绩比较基准收益率为-15.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年，在去杠杆的大环境下，市场有所动荡，主流的指数均有所调整。边际上看，宏观经济仍处于复苏阶段，经济增速没有太大的风险；随着去杠杆取得一定成效，流动性边际上有所改善，对股市有一定的利好；估值的角度来看，以中证500和中证1000为代表的中小盘风格指数的估值处于历史底部位置，沪深300为代表的大盘蓝筹风格指数也处于估值偏低的位置，股票市场整体具备估值吸引力。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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

本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

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	3,640,576.53	3,486,932.63
结算备付金		6,536,813.54	2,074,116.62
存出保证金		161,712.39	92,251.35
交易性金融资产	6.4.7.2	333,659,410.65	188,433,576.88
其中：股票投资		316,464,991.35	178,395,792.48

基金投资		-	-
债券投资		17,194,419.30	10,037,784.40
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		2,414,949.28	-
应收利息	6.4.7.5	446,198.88	58,925.83
应收股利		-	-
应收申购款		804,943.69	19,229.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		347,664,604.96	194,165,033.22
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		-	-
应付证券清算款		2,666,856.82	-
应付赎回款		139,977.66	231.51
应付管理人报酬		219,292.45	129,241.55
应付托管费		27,411.54	16,155.21
应付销售服务费		8,504.86	769.60
应付交易费用	6.4.7.7	1,389,647.93	516,062.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,713.60	140,000.00

负债合计		4,545,404.86	802,459.90
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	375,345,967.94	187,372,943.19
未分配利润	6.4.7.1 0	-32,226,767.84	5,989,630.13
所有者权益合计		343,119,200.10	193,362,573.32
负债和所有者权益总计		347,664,604.96	194,165,033.22

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额375,345,967.94份,其中下属A类基金份额264,253,794.10份,C类基金份额111,092,173.84份。下属A类基金份额净值0.9126元,C类基金份额净值0.9179元。

6.2 利润表

会计主体:创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: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	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-35,133,959.61	6,361,872.27
1. 利息收入		310,816.25	42,931.47
其中:存款利息收入	6.4.7.1 1	70,079.63	42,931.47
债券利息收入		240,736.62	-
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)		-25,013,856.10	1,912,904.73
其中:股票投资收益	6.4.7.1 2	-27,206,800.34	823,702.62

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	22,318.21	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	2,170,626.03	1,089,202.11
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-10,578,849.32	4,307,655.80
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.1 7	147,929.56	98,380.27
减：二、费用		7,292,477.46	2,685,272.65
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	1,246,903.49	712,366.17
2. 托管费	6.4.10. 2.2	155,862.93	89,045.79
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	37,324.95	6,573.16
4. 交易费用	6.4.7.1 8	5,739,798.75	1,789,141.57
5. 利息支出		2,426.22	-
其中：卖出回购金融资产支 出		2,426.22	-
6. 税金及附加		0.57	-
7. 其他费用	6.4.7.1 9	110,160.55	88,145.96
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-42,426,437.07	3,676,599.62

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,426,437.07	3,676,599.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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)	187,372,943.19	5,989,630.13	193,362,573.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,426,437.07	-42,426,437.07
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）	187,973,024.75	4,210,039.10	192,183,063.85
其中：1. 基金申购款	283,797,420.64	5,273,866.14	289,071,286.78
2. 基金赎回款	-95,824,395.89	-1,063,827.04	-96,888,222.93
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）	375,345,967.94	-32,226,767.84	343,119,200.10
项 目	上年度可比期间		

	2017年01月01日至2017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)	183,356,133.07	-13,339,372.48	170,016,760.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,676,599.62	3,676,599.62
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)	3,373,634.20	1,350,262.97	4,723,897.17
其中：1. 基金申购款	38,812,144.83	-611,906.04	38,200,238.79
2. 基金赎回款	-35,438,510.63	1,962,169.01	-33,476,341.62
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)	186,729,767.27	-8,312,509.89	178,417,257.38

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

创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]3049号《关于准予创金合信

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 \times 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) \times 5%。

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》、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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	3,640,576.53

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	3,640,576.53

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	327,933,893.73	316,464,991.35	-11,468,902.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	17,177,669.00	17,194,419.30	16,750.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	17,177,669.00	17,194,419.30	16,750.30
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	345,111,562.73	333,659,410.65	-11,452,152.08	

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	932.41
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	2,941.60
应收债券利息	442,252.07
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	72.80
合计	446,198.88

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	1,389,647.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,389,647.93

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	85.34
预提费用	93,628.26
合计	93,713.60

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	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	177,986,119.86	177,986,119.86
本期申购	142,520,036.86	142,520,036.86
本期赎回(以“-”号填列)	-56,252,362.62	-56,252,362.62
本期末	264,253,794.10	264,253,794.10

6.4.7.9.2 创金合信中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	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	9,386,823.33	9,386,823.33
本期申购	141,277,383.78	141,277,383.78
本期赎回(以“-”号填列)	-39,572,033.27	-39,572,033.27
本期末	111,092,173.84	111,092,173.84

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

6.4.7.10.1 创金合信中证500增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

强A)			
上年度末	7,329,443.22	-1,686,337.28	5,643,105.94
本期利润	-21,615,304.93	-8,175,226.35	-29,790,531.28
本期基金份额交易产生的变动数	3,042,062.02	-1,999,351.96	1,042,710.06
其中：基金申购款	5,658,882.12	-4,014,537.41	1,644,344.71
基金赎回款	-2,616,820.10	2,015,185.45	-601,634.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,243,799.69	-11,860,915.59	-23,104,715.28

6.4.7.10.2 创金合信中证500增强C

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	434,795.22	-88,271.03	346,524.19
本期利润	-10,232,282.82	-2,403,622.97	-12,635,905.79
本期基金份额交易产生的变动数	5,675,497.42	-2,508,168.38	3,167,329.04
其中：基金申购款	7,270,285.85	-3,640,764.42	3,629,521.43
基金赎回款	-1,594,788.43	1,132,596.04	-462,192.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,121,990.18	-5,000,062.38	-9,122,052.56

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	29,614.14
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	39,478.35
其他	987.14

合计	70,079.63
----	-----------

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	3,077,389,077.44
减：卖出股票成本总额	3,104,595,877.78
买卖股票差价收入	-27,206,800.34

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	22,318.21
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	22,318.21

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	5,452,464.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,352,454.00
减：应收利息总额	77,692.56
买卖债券差价收入	22,318.21

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	2,170,626.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,170,626.03

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	-10,578,849.32
——股票投资	-10,615,070.22
——债券投资	36,220.90
——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	-10,578,849.32

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	146,459.72
转换费收入	1,469.84
合计	147,929.56

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	5,739,798.75
银行间市场交易费用	-
合计	5,739,798.75

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	49,588.57
汇划手续费	5,881.13
指数使用费	24,938.07
合计	110,160.55

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
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(“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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	4,899,658,945.08	77.43%	1,637,925,049.34	89.18%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交	成交金额	占当期 债券买 卖成交

		总额的 比例		总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	12,091,364.93	76.31%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	1,500,000.00	6.10%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的 比例	期末应付佣金余额	占期 末应 付佣 金总 额的 比

				例
第一创业 证券股份 有限公司	1,569,780.21	74 .7 3%	753,197.57	54 .2 0%
	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
关联方名 称	当期佣金	占 当 期 佣 金 总 量 的 比 例	期末应付佣金余额	占 期 末 应 付 佣 金 总 额 的 比 例
第一创业 证券股份 有限公司	524,887.11	74 .1 6%	397,066.38	10 0. 00 %

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。

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201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,246,903.49	712,366.17

其中：支付销售机构的客户维护费	70,492.54	10,788.13
-----------------	-----------	-----------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，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3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	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,862.93	89,045.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
创金合信	0.00	27,726.13	27,726.13

基金			
第一创业 证券	0.00	2.54	2.54
招商银行	0.00	783.26	783.26
合计	-	28,511.93	28,511.93
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
创金合信 基金	-	4,398.39	4,398.39
合计	-	4,398.39	4,398.39

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.10%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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3个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

创金合信中证500增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.89%	2.82%

创金合信中证500增强C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.50%	52.55%

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

本报告期末及上年度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		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	3,640,576.53	29,614.14	7,597,482.70	30,196.18

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间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	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单位）	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	股)	总额	总额	
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
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	340,500	1,948,910.76	2,043,000.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	121,900	1,143,056.98	1,156,831.00	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项停牌	17.75	2018-08-01	16.12	63,504	1,100,657.00	1,127,196.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	159,900	956,616.00	933,816.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	47,900	545,487.80	517,320.00	-
600751	海航科技	2018-01-12	重大事项停牌	6.49	-	-	54,400	353,874.00	353,056.00	-
002309	中利集团	2018-02-05	重大事项停牌	14.30	2018-07-30	12.78	24,300	337,823.00	347,490.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	36,200	267,712.00	270,414.00	-

300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	34,000	190,761.00	182,580.00	-
603636	南威软件	2018-05-29	重大事项停牌	10.00	-	-	14,700	151,601.00	147,000.00	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项停牌	59.72	2018-07-16	65.69	2,100	124,524.00	125,412.00	-
300111	向日葵	2018-06-04	重大事项停牌	2.74	-	-	42,900	118,748.00	117,546.00	-
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	23,400	120,830.00	112,554.00	-
002171	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	16,500	110,003.00	111,870.00	-
300187	永清环保	2018-04-09	重大事项停牌	9.32	-	-	10,100	95,939.00	94,132.00	-

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0，无抵押债券。

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，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。

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同责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	17,043,849.30	9,607,851.00
合计	17,043,849.30	9,607,851.00

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	-	429,933.40
AAA以下	-	0.00
未评级	150,570.00	0.00
合计	150,570.00	429,933.40

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票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。

本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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》及《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。

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。于2017年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为

332,428,941.38元，超过经确认的当日净赎回金额。于2017年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为2.25%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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	3,640,576.53	-	-	-	3,640,576.53
结算备付金	6,536,813.54	-	-	-	6,536,813.54

存出保证金	161,712.39	-	-	-	161,712.39
交易性金融资产	17,194,419.30	-	-	316,464,991.35	333,659,410.65
应收证券清算款	-	-	-	2,414,949.28	2,414,949.28
应收利息	-	-	-	446,198.88	446,198.88
应收申购款	-	-	-	804,943.69	804,943.69
资产总计	27,533,521.76	-	-	320,131,083.20	347,664,604.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,666,856.82	2,666,856.82
应付赎回款	-	-	-	139,977.66	139,977.66
应付管理人报酬	-	-	-	219,292.45	219,292.45
应付托管费	-	-	-	27,411.54	27,411.54
应付销售服务费	-	-	-	8,504.86	8,504.86
应付交易费用	-	-	-	1,389,647.93	1,389,647.93
其他负债	-	-	-	93,713.60	93,713.60
负债总计	-	-	-	4,545,404.86	4,545,404.86
利率敏感度缺口	27,533,521.76	-	-	315,585,678.34	343,119,200.10
上年度末2017	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

年12月31日					
资产					
银行存款	3,486,932.63	-	-	-	3,486,932.63
结算备付金	2,074,116.62	-	-	-	2,074,116.62
存出保证金	92,251.35	-	-	-	92,251.35
交易性金融资产	9,607,851.00	429,933.40	-	178,395,792.48	188,433,576.88
应收利息	-	-	-	58,925.83	58,925.83
应收申购款	-	-	-	19,229.91	19,229.91
资产总计	15,261,151.60	429,933.40	-	178,473,948.22	194,165,033.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	231.51	231.51
应付管理人报酬	-	-	-	129,241.55	129,241.55
应付托管费	-	-	-	16,155.21	16,155.21
应付销售服务费	-	-	-	769.60	769.60
应付交易费用	-	-	-	516,062.03	516,062.03
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	802,459.90	802,459.90
利率敏感度缺口	15,261,151.60	429,933.40	-	177,671,488.32	193,362,573.32

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25个基点	-11,075.90	-19,633.51
	市场利率下降25个基点	11,111.61	19,721.06

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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	316,464,991.35	92.23	178,395,792.48	92.26
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	316,464,991.35	92.23	178,395,792.48	92.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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
分析	比较基准上涨5%资产净值变动	16,387,352.48	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-16,387,352.48	-
	比较基准上涨5%资产净值变动	-	8,364,005.10
	比较基准下降5%资产净值变动	-	-8,364,005.10

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308,736,744.20元，第二层次的余额为24,922,666.45元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次169,940,205.82元，第二层次18,493,371.06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	316,464,991.35	91.03
	其中：股票	316,464,991.35	91.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,194,419.30	4.95
	其中：债券	17,194,419.30	4.95
	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	10,177,390.07	2.93
8	其他各项资产	3,827,804.24	1.10
9	合计	347,664,604.96	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,453,066.00	1.30

B	采矿业	12,959,110.40	3.78
C	制造业	134,859,455.51	39.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,540,606.40	3.65
E	建筑业	4,404,554.00	1.28
F	批发和零售业	19,299,064.80	5.62
G	交通运输、仓储和邮政业	10,649,055.94	3.10
H	住宿和餐饮业	620,928.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,466,002.80	7.42
J	金融业	2,943,362.00	0.86
K	房地产业	17,068,105.00	4.97
L	租赁和商务服务业	6,955,021.00	2.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	746,664.00	0.22
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	4,295,003.00	1.25
S	综合	2,639,458.50	0.77
	合计	259,899,457.35	75.75

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,299,592.00	0.38
C	制造业	32,084,505.89	9.35
D	电力、热力、燃气及水	1,803,419.88	0.53

	生产和供应业		
E	建筑业	2,248,772.00	0.66
F	批发和零售业	2,479,164.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	2,167,022.00	0.63
H	住宿和餐饮业	419,526.00	0.12
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	4,396,864.80	1.28
J	金融业	3,519,606.00	1.03
K	房地产业	570,988.00	0.17
L	租赁和商务服务业	1,890,511.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	292,839.00	0.09
N	水利、环境和公共设施 管理业	1,840,238.14	0.54
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	592,118.00	0.17
S	综合	960,367.29	0.28
	合计	56,565,534.00	16.49

7.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600600	青岛啤酒	112,540	4,932,628.20	1.44
2	002078	太阳纸业	485,000	4,699,650.00	1.37
3	000997	新大陆	227,100	3,576,825.00	1.04
4	000887	中鼎股份	240,800	3,469,928.00	1.01
5	000975	银泰资源	319,520	3,239,932.80	0.94

6	002195	二三四五	705,560	3,019,796.80	0.88
7	000778	新兴铸管	701,900	3,004,132.00	0.88
8	002440	闰土股份	252,200	2,948,218.00	0.86
9	002603	以岭药业	208,500	2,914,830.00	0.85
10	000656	金科股份	574,300	2,756,640.00	0.80
11	000547	航天发展	350,505	2,737,444.05	0.80
12	600879	航天电子	388,400	2,730,452.00	0.80
13	000581	威孚高科	123,300	2,726,163.00	0.79
14	600649	城投控股	439,300	2,688,516.00	0.78
15	002299	圣农发展	173,000	2,679,770.00	0.78
16	600160	巨化股份	360,800	2,641,056.00	0.77
17	000009	中国宝安	538,665	2,639,458.50	0.77
18	600729	重庆百货	80,100	2,639,295.00	0.77
19	000028	国药一致	52,000	2,594,800.00	0.76
20	000686	东北证券	400,200	2,565,282.00	0.75
21	600037	歌华有线	244,100	2,519,112.00	0.73
22	000066	中国长城	346,200	2,461,482.00	0.72
23	600201	生物股份	142,860	2,441,477.40	0.71
24	600525	长园集团	230,800	2,439,556.00	0.71
25	600143	金发科技	463,000	2,416,860.00	0.70
26	002399	海普瑞	108,300	2,397,762.00	0.70
27	002640	跨境通	159,400	2,394,188.00	0.70
28	002373	千方科技	182,000	2,375,100.00	0.69
29	600823	世茂股份	560,100	2,341,218.00	0.68
30	603589	口子窖	37,400	2,298,230.00	0.67
31	600064	南京高科	313,100	2,298,154.00	0.67
32	000703	恒逸石化	153,100	2,278,128.00	0.66
33	600266	北京城建	240,400	2,259,760.00	0.66
34	000758	中色股份	500,000	2,250,000.00	0.66
35	002028	思源电气	133,400	2,239,786.00	0.65
36	000027	深圳能源	442,200	2,184,468.00	0.64

37	600664	哈药股份	541,400	2,149,358.00	0.63
38	600270	外运发展	102,300	2,144,208.00	0.62
39	000598	兴蓉环境	525,900	2,135,154.00	0.62
40	002056	横店东磁	302,900	2,123,329.00	0.62
41	002233	塔牌集团	182,000	2,082,080.00	0.61
42	600017	日照港	648,300	2,081,043.00	0.61
43	600582	天地科技	564,700	2,072,449.00	0.60
44	000825	太钢不锈	340,500	2,043,000.00	0.60
45	600557	康缘药业	165,214	2,040,392.90	0.59
46	600098	广州发展	315,500	2,034,975.00	0.59
47	600260	凯乐科技	75,800	2,034,472.00	0.59
48	601717	郑煤机	339,600	1,973,076.00	0.58
49	600056	中国医药	107,610	1,966,034.70	0.57
50	002180	纳思达	70,700	1,941,422.00	0.57
51	600580	卧龙电气	254,200	1,937,004.00	0.56
52	600256	广汇能源	466,140	1,906,512.60	0.56
53	600282	南钢股份	428,900	1,895,738.00	0.55
54	300297	蓝盾股份	233,000	1,889,630.00	0.55
55	002221	东华能源	190,700	1,863,139.00	0.54
56	002400	省广集团	572,400	1,848,852.00	0.54
57	002317	众生药业	170,400	1,801,128.00	0.52
58	300308	中际旭创	29,700	1,783,188.00	0.52
59	601928	凤凰传媒	292,900	1,780,832.00	0.52
60	600611	大众交通	445,753	1,774,096.94	0.52
61	000592	平潭发展	624,400	1,773,296.00	0.52
62	002152	广电运通	298,500	1,755,180.00	0.51
63	600578	京能电力	560,700	1,749,384.00	0.51
64	000937	冀中能源	423,200	1,739,352.00	0.51
65	600584	长电科技	102,000	1,727,880.00	0.50
66	600511	国药股份	63,300	1,705,935.00	0.50
67	300287	飞利信	230,600	1,658,014.00	0.48

68	000541	佛山照明	275,170	1,648,268.30	0.48
69	000969	安泰科技	263,600	1,647,500.00	0.48
70	002093	国脉科技	212,000	1,634,520.00	0.48
71	601880	大连港	841,200	1,631,928.00	0.48
72	601168	西部矿业	259,100	1,627,148.00	0.47
73	000418	小天鹅 A	23,196	1,608,642.60	0.47
74	002268	卫士通	73,000	1,593,590.00	0.46
75	002642	荣之联	173,100	1,590,789.00	0.46
76	000078	海王生物	328,800	1,581,528.00	0.46
77	300058	蓝色光标	274,600	1,565,220.00	0.46
78	300257	开山股份	101,900	1,558,051.00	0.45
79	002064	华峰氨纶	376,500	1,554,945.00	0.45
80	002022	科华生物	131,200	1,554,720.00	0.45
81	000021	深科技	227,000	1,548,140.00	0.45
82	002663	普邦股份	500,200	1,485,594.00	0.43
83	600639	浦东金桥	118,300	1,476,384.00	0.43
84	002127	南极电商	154,900	1,454,511.00	0.42
85	002588	史丹利	275,764	1,428,457.52	0.42
86	600872	中炬高新	48,700	1,363,600.00	0.40
87	000031	中粮地产	235,100	1,358,878.00	0.40
88	600350	山东高速	333,100	1,349,055.00	0.39
89	000729	燕京啤酒	195,600	1,316,388.00	0.38
90	300039	上海凯宝	223,300	1,295,140.00	0.38
91	600863	内蒙华电	569,000	1,291,630.00	0.38
92	600315	上海家化	32,300	1,280,049.00	0.37
93	600640	号百控股	125,800	1,279,386.00	0.37
94	600058	五矿发展	151,400	1,258,134.00	0.37
95	600500	中化国际	182,900	1,247,378.00	0.36
96	002276	万马股份	213,500	1,246,840.00	0.36
97	000685	中山公用	156,200	1,244,914.00	0.36
98	600655	豫园股份	131,304	1,240,822.80	0.36

99	600062	华润双鹤	50,500	1,239,775.00	0.36
100	001696	宗申动力	250,300	1,226,470.00	0.36
101	000848	承德露露	113,600	1,203,024.00	0.35
102	002261	拓维信息	256,900	1,181,740.00	0.34
103	002375	亚厦股份	220,300	1,176,402.00	0.34
104	000552	靖远煤电	359,600	1,175,892.00	0.34
105	600267	海正药业	80,800	1,174,832.00	0.34
106	300324	旋极信息	121,900	1,156,831.00	0.34
107	000528	柳工	106,800	1,143,828.00	0.33
108	600079	人福医药	86,100	1,138,242.00	0.33
109	002013	中航机电	150,000	1,135,500.00	0.33
110	002414	高德红外	83,901	1,127,629.44	0.33
111	600750	江中药业	63,504	1,127,196.00	0.33
112	002544	杰赛科技	81,500	1,115,735.00	0.33
113	600827	百联股份	102,100	1,041,420.00	0.30
114	000543	皖能电力	232,540	1,025,501.40	0.30
115	002251	步步高	89,900	1,023,062.00	0.30
116	000519	中兵红箭	130,100	1,010,877.00	0.29
117	002463	沪电股份	267,900	1,001,946.00	0.29
118	600565	迪马股份	331,700	978,515.00	0.29
119	300159	新研股份	133,200	943,056.00	0.27
120	600875	东方电气	126,000	933,660.00	0.27
121	600216	浙江医药	73,100	933,487.00	0.27
122	002179	中航光电	23,500	916,500.00	0.27
123	600970	中材国际	135,400	904,472.00	0.26
124	000156	华数传媒	93,100	897,484.00	0.26
125	600151	航天机电	220,700	896,042.00	0.26
126	603328	依顿电子	80,000	868,000.00	0.25
127	002250	联化科技	96,700	852,894.00	0.25
128	600757	长江传媒	148,900	847,241.00	0.25
129	601311	骆驼股份	72,600	832,722.00	0.24

130	300113	顺网科技	47,700	830,457.00	0.24
131	002701	奥瑞金	145,500	794,430.00	0.23
132	600426	华鲁恒升	44,400	780,996.00	0.23
133	000690	宝新能源	110,800	771,168.00	0.22
134	002424	贵州百灵	67,600	767,936.00	0.22
135	002368	太极股份	26,100	758,727.00	0.22
136	600292	远达环保	127,200	746,664.00	0.22
137	600316	洪都航空	79,100	737,212.00	0.21
138	000999	华润三九	26,100	726,363.00	0.21
139	600859	王府井	33,100	704,037.00	0.21
140	600366	宁波韵升	114,000	695,400.00	0.20
141	002244	滨江集团	133,000	691,600.00	0.20
142	002482	广田集团	109,800	655,506.00	0.19
143	300182	捷成股份	82,500	625,350.00	0.18
144	600754	锦江股份	16,800	620,928.00	0.18
145	002353	杰瑞股份	38,000	617,500.00	0.18
146	600572	康恩贝	85,600	613,752.00	0.18
147	603885	吉祥航空	39,700	611,777.00	0.18
148	300315	掌趣科技	135,200	565,136.00	0.16
149	000049	德赛电池	19,500	550,290.00	0.16
150	600521	华海药业	20,400	544,476.00	0.16
151	601020	华钰矿业	39,000	537,810.00	0.16
152	601000	唐山港	217,200	510,420.00	0.15
153	002004	华邦健康	100,200	509,016.00	0.15
154	600138	中青旅	24,400	486,292.00	0.14
155	000762	西藏矿业	50,100	482,463.00	0.14
156	600755	厦门国贸	65,900	480,411.00	0.14
157	603806	福斯特	21,700	477,617.00	0.14
158	603899	晨光文具	14,900	472,181.00	0.14
159	300026	红日药业	128,800	470,120.00	0.14
160	600835	上海机电	22,900	431,894.00	0.13

161	000012	南玻 A	86,132	426,353.40	0.12
162	600120	浙江东方	30,940	419,237.00	0.12
163	000563	陕国投 A	111,200	378,080.00	0.11
164	000738	航发控制	26,900	358,577.00	0.10
165	600751	海航科技	54,400	353,056.00	0.10
166	000536	华映科技	118,800	326,700.00	0.10
167	000061	农产品	59,400	320,760.00	0.09
168	002073	软控股份	48,500	278,875.00	0.08
169	000089	深圳机场	36,400	278,460.00	0.08
170	600717	天津港	35,600	268,068.00	0.08
171	002506	协鑫集成	52,400	245,232.00	0.07
172	600183	生益科技	26,200	239,992.00	0.07
173	600748	上实发展	42,200	212,688.00	0.06
174	600126	杭钢股份	34,800	207,756.00	0.06
175	600141	兴发集团	16,800	195,720.00	0.06
176	300197	铁汉生态	34,000	182,580.00	0.05
177	601098	中南传媒	11,400	144,096.00	0.04
178	600642	申能股份	20,600	103,412.00	0.03
179	600808	马钢股份	26,100	93,699.00	0.03
180	300274	阳光电源	10,100	90,597.00	0.03
181	600623	华谊集团	8,600	85,828.00	0.03
182	600184	光电股份	1,100	13,629.00	0.00
183	000926	福星股份	800	5,752.00	0.00

7.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000415	渤海金控	159,900	933,816.00	0.27
2	300427	红相股份	46,400	668,160.00	0.19
3	300150	世纪瑞尔	132,600	640,458.00	0.19

4	600602	云赛智联	109,600	635,680.00	0.19
5	600831	广电网络	104,700	630,294.00	0.18
6	002501	利源精制	101,500	629,300.00	0.18
7	002478	常宝股份	139,600	625,408.00	0.18
8	600491	龙元建设	89,400	624,906.00	0.18
9	600705	中航资本	133,700	624,379.00	0.18
10	000858	五粮液	8,200	623,200.00	0.18
11	002304	洋河股份	4,700	618,520.00	0.18
12	600516	方大炭素	25,000	609,500.00	0.18
13	002091	江苏国泰	95,500	606,425.00	0.18
14	002298	中电兴发	85,500	603,630.00	0.18
15	300442	普丽盛	35,800	599,650.00	0.17
16	002484	江海股份	90,900	594,486.00	0.17
17	000088	盐田港	80,100	527,859.00	0.15
18	300190	维尔利	95,740	521,783.00	0.15
19	000651	格力电器	11,000	518,650.00	0.15
20	300395	菲利华	38,100	518,160.00	0.15
21	300118	东方日升	47,900	517,320.00	0.15
22	002217	合力泰	62,600	516,450.00	0.15
23	300346	南大光电	39,410	513,512.30	0.15
24	300296	利亚德	39,600	510,048.00	0.15
25	002415	海康威视	13,700	508,681.00	0.15
26	002311	海大集团	24,000	506,400.00	0.15
27	002402	和而泰	60,800	504,640.00	0.15
28	002391	长青股份	39,400	503,532.00	0.15
29	600153	建发股份	56,000	503,440.00	0.15
30	600170	上海建工	163,600	497,344.00	0.14
31	000883	湖北能源	120,973	497,199.03	0.14
32	002393	力生制药	20,300	496,944.00	0.14
33	300438	鹏辉能源	25,600	494,336.00	0.14
34	601898	中煤能源	102,000	492,660.00	0.14

35	002687	乔治白	91,200	489,744.00	0.14
36	002142	宁波银行	30,000	488,700.00	0.14
37	600805	悦达投资	94,213	480,486.30	0.14
38	000551	创元科技	82,881	479,880.99	0.14
39	000058	深赛格	92,400	473,088.00	0.14
40	600585	海螺水泥	14,100	472,068.00	0.14
41	002406	远东传动	85,700	470,493.00	0.14
42	601318	中国平安	8,000	468,640.00	0.14
43	601857	中国石油	60,400	465,684.00	0.14
44	601877	正泰电器	20,800	464,256.00	0.14
45	002144	宏达高科	41,400	462,438.00	0.13
46	600016	民生银行	63,900	447,300.00	0.13
47	600519	贵州茅台	600	438,876.00	0.13
48	000524	岭南控股	45,900	419,526.00	0.12
49	002422	科伦药业	12,475	400,447.50	0.12
50	002654	万润科技	72,100	395,829.00	0.12
51	300351	永贵电器	30,700	384,671.00	0.11
52	000568	泸州老窖	6,300	383,418.00	0.11
53	002349	精华制药	65,500	382,520.00	0.11
54	300422	博世科	26,700	380,475.00	0.11
55	300292	吴通控股	103,400	378,444.00	0.11
56	002543	万和电气	19,500	376,740.00	0.11
57	600168	武汉控股	58,300	376,618.00	0.11
58	601398	工商银行	70,600	375,592.00	0.11
59	300460	惠伦晶体	34,400	356,040.00	0.10
60	601888	中国国旅	5,500	354,255.00	0.10
61	002331	皖通科技	47,300	350,020.00	0.10
62	300040	九洲电气	59,600	349,852.00	0.10
63	002487	大金重工	95,200	348,432.00	0.10
64	002309	中利集团	24,300	347,490.00	0.10
65	600973	宝胜股份	95,200	347,480.00	0.10

66	600019	宝钢股份	44,300	345,097.00	0.10
67	002255	海陆重工	65,500	339,290.00	0.10
68	002374	丽鹏股份	64,200	312,654.00	0.09
69	600888	新疆众和	51,670	290,902.10	0.08
70	002653	海思科	23,700	284,400.00	0.08
71	601390	中国中铁	36,200	270,414.00	0.08
72	300303	聚飞光电	96,020	263,094.80	0.08
73	000333	美的集团	5,000	261,100.00	0.08
74	002380	科远股份	19,900	258,700.00	0.08
75	002334	英威腾	43,700	255,645.00	0.07
76	002449	国星光电	24,010	255,466.40	0.07
77	600662	强生控股	63,900	254,961.00	0.07
78	300432	富临精工	29,000	254,040.00	0.07
79	300144	宋城演艺	10,800	253,800.00	0.07
80	600676	交运股份	51,000	253,470.00	0.07
81	600706	曲江文旅	22,400	253,120.00	0.07
82	002095	生意宝	7,000	251,230.00	0.07
83	600887	伊利股份	9,000	251,100.00	0.07
84	600420	现代制药	24,100	250,640.00	0.07
85	300305	裕兴股份	41,400	250,470.00	0.07
86	600741	华域汽车	10,500	249,060.00	0.07
87	600027	华电国际	63,400	248,528.00	0.07
88	000001	平安银行	27,200	247,248.00	0.07
89	000548	湖南投资	56,400	247,032.00	0.07
90	000682	东方电子	63,800	244,992.00	0.07
91	300408	三环集团	10,400	244,400.00	0.07
92	601186	中国铁建	28,200	243,084.00	0.07
93	601965	中国汽研	28,700	240,506.00	0.07
94	002287	奇正藏药	8,300	238,957.00	0.07
95	002202	金风科技	18,900	238,896.00	0.07
96	300463	迈克生物	9,100	226,863.00	0.07

97	300200	高盟新材	27,200	225,760.00	0.07
98	002236	大华股份	10,000	225,500.00	0.07
99	300446	乐凯新材	12,200	224,602.00	0.07
100	002315	焦点科技	15,500	224,130.00	0.07
101	000965	天保基建	50,400	222,768.00	0.06
102	600386	北巴传媒	56,900	221,341.00	0.06
103	002671	龙泉股份	49,600	221,216.00	0.06
104	600710	苏美达	50,800	219,456.00	0.06
105	000719	中原传媒	32,600	218,094.00	0.06
106	600894	广日股份	36,700	217,631.00	0.06
107	002561	徐家汇	24,000	217,200.00	0.06
108	601566	九牧王	14,700	216,825.00	0.06
109	600028	中国石化	33,100	214,819.00	0.06
110	002429	兆驰股份	86,300	214,024.00	0.06
111	300121	阳谷华泰	13,700	192,211.00	0.06
112	601601	中国太保	6,000	191,100.00	0.06
113	002398	建研集团	35,700	180,285.00	0.05
114	000876	新希望	28,000	177,520.00	0.05
115	000826	启迪桑德	9,300	162,564.00	0.05
116	603636	南威软件	14,700	147,000.00	0.04
117	600461	洪城水业	22,300	140,044.00	0.04
118	600061	国投资本	14,800	137,344.00	0.04
119	002682	龙洲股份	16,500	135,795.00	0.04
120	600050	中国联通	27,300	134,316.00	0.04
121	300232	洲明科技	13,260	131,008.80	0.04
122	000555	神州信息	9,800	130,144.00	0.04
123	002335	科华恒盛	7,200	129,960.00	0.04
124	002156	通富微电	12,000	129,960.00	0.04
125	300178	腾邦国际	9,200	129,352.00	0.04
126	002649	博彦科技	14,100	128,592.00	0.04
127	600330	天通股份	18,680	127,958.00	0.04

128	603558	健盛集团	14,500	127,745.00	0.04
129	300098	高新兴	16,000	127,680.00	0.04
130	300285	国瓷材料	6,400	127,616.00	0.04
131	002245	澳洋顺昌	19,700	127,459.00	0.04
132	002519	银河电子	28,700	127,428.00	0.04
133	002631	德尔未来	17,200	127,280.00	0.04
134	600690	青岛海尔	6,600	127,116.00	0.04
135	002139	拓邦股份	22,300	126,887.00	0.04
136	002662	京威股份	30,200	126,840.00	0.04
137	600288	大恒科技	16,300	126,488.00	0.04
138	002546	新联电子	33,900	126,447.00	0.04
139	603993	洛阳钼业	20,100	126,429.00	0.04
140	300011	鼎汉技术	19,800	126,324.00	0.04
141	002107	沃华医药	13,709	126,259.89	0.04
142	600337	美克家居	21,500	125,990.00	0.04
143	002360	同德化工	23,100	125,895.00	0.04
144	000623	吉林敖东	7,000	125,860.00	0.04
145	600736	苏州高新	20,800	125,840.00	0.04
146	601333	广深铁路	29,600	125,800.00	0.04
147	600809	山西汾酒	2,000	125,780.00	0.04
148	600048	保利地产	10,300	125,660.00	0.04
149	002061	浙江交科	12,000	125,640.00	0.04
150	000652	泰达股份	40,200	125,424.00	0.04
151	603939	益丰药房	2,100	125,412.00	0.04
152	300473	德尔股份	3,301	125,272.95	0.04
153	601107	四川成渝	36,500	125,195.00	0.04
154	000404	长虹华意	28,900	125,137.00	0.04
155	600893	航发动力	5,600	124,992.00	0.04
156	300172	中电环保	22,200	124,986.00	0.04
157	300119	瑞普生物	14,600	124,830.00	0.04
158	600548	深高速	15,900	124,815.00	0.04

159	600816	安信信托	17,200	124,528.00	0.04
160	002379	宏创控股	37,500	124,500.00	0.04
161	000531	穗恒运 A	24,800	124,496.00	0.04
162	600000	浦发银行	13,000	124,280.00	0.04
163	000767	漳泽电力	48,700	124,185.00	0.04
164	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.04
165	603869	北部湾旅	7,500	123,675.00	0.04
166	600886	国投电力	17,000	123,590.00	0.04
167	600518	康美药业	5,400	123,552.00	0.04
168	300122	智飞生物	2,700	123,498.00	0.04
169	300381	溢多利	14,100	122,811.00	0.04
170	600377	宁沪高速	13,500	122,580.00	0.04
171	600104	上汽集团	3,500	122,465.00	0.04
172	600009	上海机场	2,200	122,056.00	0.04
173	002258	利尔化学	6,300	121,968.00	0.04
174	600775	南京熊猫	21,500	121,690.00	0.04
175	000898	鞍钢股份	21,700	120,869.00	0.04
176	601126	四方股份	23,700	120,633.00	0.04
177	002454	松芝股份	20,500	120,335.00	0.04
178	601369	陕鼓动力	18,800	120,320.00	0.04
179	600551	时代出版	13,600	120,224.00	0.04
180	601288	农业银行	34,900	120,056.00	0.03
181	002550	千红制药	21,400	119,626.00	0.03
182	000026	飞亚达 A	13,500	119,070.00	0.03
183	300482	万孚生物	1,700	119,000.00	0.03
184	002493	荣盛石化	11,500	118,680.00	0.03
185	300111	向日葵	42,900	117,546.00	0.03
186	300008	天海防务	23,400	112,554.00	0.03
187	002171	楚江新材	16,500	111,870.00	0.03
188	002294	信立泰	3,000	111,510.00	0.03
189	600352	浙江龙盛	8,400	100,380.00	0.03

190	002401	中远海科	10,000	100,300.00	0.03
191	002206	海利得	19,900	99,301.00	0.03
192	300069	金利华电	8,300	99,102.00	0.03
193	603808	歌力思	4,400	99,044.00	0.03
194	300050	世纪鼎利	16,400	98,400.00	0.03
195	300388	国祯环保	5,100	98,277.00	0.03
196	002238	天威视讯	14,560	97,988.80	0.03
197	000906	浙商中拓	19,000	97,660.00	0.03
198	000919	金陵药业	13,000	97,370.00	0.03
199	002060	粤水电	33,200	97,276.00	0.03
200	002187	广百股份	11,800	97,232.00	0.03
201	601368	绿城水务	14,400	97,200.00	0.03
202	002243	通产丽星	17,200	97,180.00	0.03
203	002498	汉缆股份	43,900	97,019.00	0.03
204	300020	银江股份	10,200	97,002.00	0.03
205	000413	东旭光电	16,000	96,960.00	0.03
206	002314	南山控股	24,000	96,720.00	0.03
207	000059	华锦股份	14,000	96,460.00	0.03
208	000538	云南白药	900	96,264.00	0.03
209	601998	中信银行	15,500	96,255.00	0.03
210	601567	三星医疗	13,200	96,096.00	0.03
211	603288	海天味业	1,300	95,732.00	0.03
212	600085	同仁堂	2,700	95,256.00	0.03
213	300187	永清环保	10,100	94,132.00	0.03
214	002403	爱仕达	9,600	86,496.00	0.03
215	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
216	002775	文科园林	5,800	76,444.00	0.02
217	000617	中油资本	6,600	74,184.00	0.02
218	002126	银轮股份	7,000	63,140.00	0.02
219	300485	赛升药业	4,300	61,877.00	0.02
220	603023	威帝股份	10,133	58,467.41	0.02

221	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
222	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
223	002112	三变科技	5,700	37,905.00	0.01
224	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
225	600278	东方创业	2,600	20,514.00	0.01
226	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	-
227	002081	金螳螂	100	1,010.00	-

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	27,396,404.48	14.17
2	600426	华鲁恒升	27,177,418.88	14.06
3	000418	小天鹅A	22,717,062.87	11.75
4	002078	太阳纸业	20,406,597.79	10.55
5	600176	中国巨石	18,175,069.21	9.40
6	600201	生物股份	17,801,789.63	9.21
7	300182	捷成股份	17,541,947.71	9.07
8	600062	华润双鹤	17,438,564.22	9.02
9	000690	宝新能源	17,192,414.48	8.89
10	600525	长园集团	17,129,486.49	8.86
11	000786	北新建材	17,107,149.66	8.85
12	002244	滨江集团	17,058,483.00	8.82
13	002050	三花智控	16,904,465.00	8.74
14	000778	新兴铸管	16,867,875.39	8.72
15	300274	阳光电源	16,621,767.35	8.60
16	600755	厦门国贸	16,341,241.66	8.45
17	002195	二三四五	16,327,436.00	8.44
18	000581	威孚高科	16,210,363.02	8.38

19	000039	中集集团	16,194,744.08	8.38
20	600521	华海药业	15,441,063.31	7.99
21	600511	国药股份	15,388,353.68	7.96
22	600642	申能股份	15,351,533.00	7.94
23	603589	口子窖	14,841,044.60	7.68
24	000997	新大陆	14,558,245.00	7.53
25	000078	海王生物	14,448,132.60	7.47
26	600256	广汇能源	14,036,390.00	7.26
27	600600	青岛啤酒	13,507,448.50	6.99
28	600884	杉杉股份	13,492,307.00	6.98
29	600240	华业资本	13,369,417.73	6.91
30	002311	海大集团	13,352,525.00	6.91
31	600143	金发科技	13,078,274.00	6.76
32	000541	佛山照明	12,962,147.80	6.70
33	603369	今世缘	12,953,258.95	6.70
34	002152	广电运通	12,717,648.33	6.58
35	600859	王府井	12,655,347.00	6.54
36	002589	瑞康医药	12,542,346.20	6.49
37	002439	启明星辰	12,476,576.13	6.45
38	002001	新和成	12,421,379.67	6.42
39	600056	中国医药	12,163,408.43	6.29
40	002440	闰土股份	12,152,559.66	6.28
41	600566	济川药业	12,106,596.24	6.26
42	600655	豫园股份	12,078,538.36	6.25
43	002013	中航机电	12,073,243.75	6.24
44	000937	冀中能源	12,001,602.10	6.21
45	000998	隆平高科	11,865,984.73	6.14
46	002271	东方雨虹	11,825,316.05	6.12
47	000703	恒逸石化	11,789,960.27	6.10
48	000661	长春高新	11,716,355.12	6.06
49	002179	中航光电	11,544,906.00	5.97

50	600004	白云机场	11,482,829.00	5.94
51	000887	中鼎股份	11,479,090.03	5.94
52	002221	东华能源	11,451,537.91	5.92
53	600079	人福医药	11,224,456.92	5.80
54	002056	横店东磁	11,188,794.47	5.79
55	600438	通威股份	11,088,174.14	5.73
56	600729	重庆百货	11,059,626.52	5.72
57	601168	西部矿业	10,965,391.64	5.67
58	601006	大秦铁路	10,678,452.89	5.52
59	601717	郑煤机	10,581,640.61	5.47
60	002268	卫士通	10,488,992.45	5.42
61	600266	北京城建	10,462,528.36	5.41
62	000066	中国长城	10,444,619.64	5.40
63	601233	桐昆股份	10,402,956.00	5.38
64	000667	美好置业	10,398,105.62	5.38
65	000656	金科股份	10,192,165.00	5.27
66	600633	浙数文化	10,081,519.02	5.21
67	000990	诚志股份	10,030,714.23	5.19
68	600582	天地科技	9,939,359.00	5.14
69	000977	浪潮信息	9,899,766.20	5.12
70	002032	苏泊尔	9,877,934.72	5.11
71	300088	长信科技	9,831,614.20	5.08
72	000090	天健集团	9,812,936.60	5.07
73	300287	飞利信	9,810,122.55	5.07
74	600754	锦江股份	9,798,298.21	5.07
75	002191	劲嘉股份	9,764,060.00	5.05
76	000050	深天马 A	9,724,828.44	5.03
77	000975	银泰资源	9,720,901.00	5.03
78	002463	沪电股份	9,693,757.73	5.01
79	600885	宏发股份	9,660,370.13	5.00
80	002127	南极电商	9,389,478.54	4.86

81	600673	东阳光科	9,279,161.71	4.80
82	000536	华映科技	9,270,763.20	4.79
83	600260	凯乐科技	9,261,863.75	4.79
84	600557	康缘药业	9,180,286.15	4.75
85	000685	中山公用	9,146,182.00	4.73
86	600875	东方电气	9,139,503.80	4.73
87	000552	靖远煤电	9,119,374.00	4.72
88	600611	大众交通	9,007,987.68	4.66
89	002603	以岭药业	8,895,584.00	4.60
90	600282	南钢股份	8,875,453.37	4.59
91	000021	深科技	8,845,880.00	4.57
92	002482	广田集团	8,822,572.00	4.56
93	601231	环旭电子	8,809,276.37	4.56
94	002299	圣农发展	8,775,217.00	4.54
95	002064	华峰氨纶	8,739,935.59	4.52
96	600216	浙江医药	8,732,065.01	4.52
97	600808	马钢股份	8,699,837.00	4.50
98	000969	安泰科技	8,699,696.93	4.50
99	600970	中材国际	8,675,381.61	4.49
100	600694	大商股份	8,645,579.28	4.47
101	002233	塔牌集团	8,638,438.00	4.47
102	300133	华策影视	8,637,188.37	4.47
103	600578	京能电力	8,570,608.38	4.43
104	002410	广联达	8,491,739.94	4.39
105	000848	承德露露	8,474,721.97	4.38
106	000028	国药一致	8,420,763.80	4.35
107	000547	航天发展	8,358,403.59	4.32
108	600366	宁波韵升	8,233,877.00	4.26
109	600138	中青旅	8,149,014.02	4.21
110	600466	蓝光发展	8,145,297.80	4.21
111	600277	亿利洁能	8,123,606.00	4.20

112	000027	深圳能源	8,108,992.85	4.19
113	600565	迪马股份	8,026,455.00	4.15
114	600346	恒力股份	7,994,771.08	4.13
115	002491	通鼎互联	7,991,099.14	4.13
116	600580	卧龙电气	7,990,161.94	4.13
117	300383	光环新网	7,910,335.00	4.09
118	600284	浦东建设	7,908,171.80	4.09
119	600269	赣粤高速	7,863,799.00	4.07
120	600863	内蒙华电	7,849,094.84	4.06
121	002444	巨星科技	7,837,857.00	4.05
122	002038	双鹭药业	7,721,285.57	3.99
123	600835	上海机电	7,684,619.96	3.97
124	002640	跨境通	7,675,521.00	3.97
125	000902	新洋丰	7,653,535.00	3.96
126	000488	晨鸣纸业	7,645,830.40	3.95
127	600094	大名城	7,633,159.58	3.95
128	000596	古井贡酒	7,628,443.95	3.95
129	603766	隆鑫通用	7,558,613.88	3.91
130	000598	兴蓉环境	7,554,589.00	3.91
131	000012	南玻A	7,498,220.40	3.88
132	600486	扬农化工	7,462,512.80	3.86
133	600315	上海家化	7,449,587.54	3.85
134	600584	长电科技	7,447,269.60	3.85
135	600395	盘江股份	7,418,633.15	3.84
136	600651	飞乐音响	7,412,930.00	3.83
137	601678	滨化股份	7,394,277.38	3.82
138	300039	上海凯宝	7,381,837.48	3.82
139	600639	浦东金桥	7,376,071.00	3.81
140	000926	福星股份	7,289,342.00	3.77
141	000543	皖能电力	7,234,178.10	3.74
142	002277	友阿股份	7,220,989.00	3.73

143	600801	华新水泥	7,165,816.82	3.71
144	000400	许继电气	7,142,002.30	3.69
145	000009	中国宝安	7,072,746.05	3.66
146	600900	长江电力	7,035,925.00	3.64
147	002176	江特电机	7,022,154.52	3.63
148	600748	上实发展	7,010,562.60	3.63
149	002373	千方科技	6,969,751.00	3.60
150	002223	鱼跃医疗	6,963,290.95	3.60
151	002518	科士达	6,956,457.00	3.60
152	000999	华润三九	6,883,060.12	3.56
153	000718	苏宁环球	6,878,413.56	3.56
154	002019	亿帆医药	6,849,371.00	3.54
155	600151	航天机电	6,805,816.00	3.52
156	600017	日照港	6,798,129.00	3.52
157	000830	鲁西化工	6,735,134.00	3.48
158	600548	深高速	6,730,227.79	3.48
159	000860	顺鑫农业	6,719,924.03	3.48
160	002304	洋河股份	6,679,172.60	3.45
161	600098	广州发展	6,674,624.93	3.45
162	300055	万邦达	6,635,045.00	3.43
163	002416	爱施德	6,618,983.97	3.42
164	600160	巨化股份	6,517,508.34	3.37
165	600037	歌华有线	6,426,667.00	3.32
166	000528	柳工	6,403,965.58	3.31
167	600572	康恩贝	6,400,467.62	3.31
168	600236	桂冠电力	6,369,393.00	3.29
169	600169	太原重工	6,328,304.00	3.27
170	000519	中兵红箭	6,265,119.00	3.24
171	002004	华邦健康	6,164,172.00	3.19
172	601928	凤凰传媒	6,153,120.48	3.18
173	600881	亚泰集团	6,125,514.99	3.17

174	000818	航锦科技	6,101,395.00	3.16
175	000501	鄂武商 A	6,086,498.36	3.15
176	000089	深圳机场	6,070,857.00	3.14
177	600317	营口港	6,064,925.00	3.14
178	600141	兴发集团	6,030,783.80	3.12
179	002503	搜于特	6,010,236.17	3.11
180	601311	骆驼股份	5,939,773.00	3.07
181	002093	国脉科技	5,908,129.00	3.06
182	000636	风华高科	5,865,289.00	3.03
183	600585	海螺水泥	5,855,888.97	3.03
184	000513	丽珠集团	5,843,920.00	3.02
185	600872	中炬高新	5,751,459.89	2.97
186	601222	林洋能源	5,737,950.00	2.97
187	300257	开山股份	5,711,484.00	2.95
188	300113	顺网科技	5,657,077.15	2.93
189	300202	聚龙股份	5,591,028.34	2.89
190	300026	红日药业	5,590,566.00	2.89
191	600894	广日股份	5,563,793.72	2.88
192	000729	燕京啤酒	5,548,254.00	2.87
193	300159	新研股份	5,528,861.00	2.86
194	600879	航天电子	5,517,583.00	2.85
195	600195	中牧股份	5,507,908.00	2.85
196	600267	海正药业	5,449,095.00	2.82
197	000612	焦作万方	5,445,827.08	2.82
198	601699	潞安环能	5,303,260.00	2.74
199	000758	中色股份	5,286,583.00	2.73
200	600787	中储股份	5,261,212.22	2.72
201	000563	陕国投 A	5,254,859.93	2.72
202	002340	格林美	5,238,225.00	2.71
203	000727	华东科技	5,228,964.00	2.70
204	002635	安洁科技	5,225,259.00	2.70

205	600623	华谊集团	5,200,585.00	2.69
206	000030	富奥股份	5,194,598.00	2.69
207	600028	中国石化	5,159,004.00	2.67
208	600664	哈药股份	5,155,889.12	2.67
209	300297	蓝盾股份	5,133,568.00	2.65
210	600674	川投能源	5,129,102.00	2.65
211	600837	海通证券	5,127,469.00	2.65
212	300058	蓝色光标	5,091,995.06	2.63
213	600270	外运发展	5,066,669.00	2.62
214	600064	南京高科	5,035,928.35	2.60
215	600348	阳泉煤业	5,035,184.00	2.60
216	002073	软控股份	5,006,706.00	2.59
217	001696	宗申动力	5,005,437.00	2.59
218	600126	杭钢股份	5,004,582.73	2.59
219	002051	中工国际	4,882,337.40	2.52
220	000158	常山北明	4,872,626.00	2.52
221	002588	史丹利	4,846,794.96	2.51
222	600978	宜华生活	4,844,038.99	2.51
223	600750	江中药业	4,836,176.00	2.50
224	000031	中粮地产	4,815,152.77	2.49
225	600811	东方集团	4,814,876.39	2.49
226	002025	航天电器	4,724,137.44	2.44
227	603328	依顿电子	4,721,687.86	2.44
228	600640	号百控股	4,716,679.84	2.44
229	002276	万马股份	4,701,059.00	2.43
230	002400	省广集团	4,695,925.00	2.43
231	002663	普邦股份	4,664,391.40	2.41
232	600743	华远地产	4,656,510.74	2.41
233	000988	华工科技	4,653,497.00	2.41
234	002396	星网锐捷	4,646,375.75	2.40
235	600170	上海建工	4,619,431.00	2.39

236	601567	三星医疗	4,617,936.00	2.39
237	000426	兴业矿业	4,608,177.99	2.38
238	601000	唐山港	4,607,678.00	2.38
239	000960	锡业股份	4,588,156.30	2.37
240	600597	光明乳业	4,587,120.20	2.37
241	603288	海天味业	4,562,969.51	2.36
242	000761	本钢板材	4,557,655.00	2.36
243	600657	信达地产	4,553,253.02	2.35
244	600522	中天科技	4,531,751.50	2.34
245	603025	大豪科技	4,390,543.86	2.27
246	601107	四川成渝	4,371,402.99	2.26
247	000652	泰达股份	4,366,584.00	2.26
248	603658	安图生物	4,349,745.20	2.25
249	600757	长江传媒	4,337,801.00	2.24
250	600298	安琪酵母	4,325,937.99	2.24
251	603001	奥康国际	4,311,215.98	2.23
252	002250	联化科技	4,300,630.00	2.22
253	600519	贵州茅台	4,237,673.77	2.19
254	601088	中国神华	4,199,261.00	2.17
255	300114	中航电测	4,154,227.12	2.15
256	600718	东软集团	4,153,762.61	2.15
257	002048	宁波华翔	4,148,701.00	2.15
258	002261	拓维信息	4,101,188.88	2.12
259	600777	新潮能源	4,091,747.00	2.12
260	300002	神州泰岳	4,073,966.98	2.11
261	000686	东北证券	4,031,271.69	2.08
262	002266	浙富控股	3,998,678.60	2.07
263	600335	国机汽车	3,942,442.55	2.04
264	002028	思源电气	3,928,050.00	2.03
265	600337	美克家居	3,904,272.00	2.02
266	600219	南山铝业	3,886,626.00	2.01

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	002422	科伦药业	27,264,185.77	14.10
2	600426	华鲁恒升	26,825,066.18	13.87
3	000418	小天鹅A	22,193,822.19	11.48
4	000786	北新建材	19,181,939.59	9.92
5	300182	捷成股份	18,932,272.71	9.79
6	600176	中国巨石	18,319,824.26	9.47
7	600525	长园集团	17,883,539.01	9.25
8	300274	阳光电源	17,333,585.03	8.96
9	002050	三花智控	17,013,808.12	8.80
10	600755	厦门国贸	16,499,546.72	8.53
11	600062	华润双鹤	16,391,387.70	8.48
12	000690	宝新能源	16,237,441.00	8.40
13	000581	威孚高科	15,813,752.38	8.18
14	002244	滨江集团	15,797,780.60	8.17
15	002078	太阳纸业	15,636,842.01	8.09
16	600521	华海药业	15,533,059.01	8.03
17	002311	海大集团	15,385,134.25	7.96
18	600642	申能股份	15,352,982.88	7.94
19	002195	二三四五	15,143,325.00	7.83
20	000039	中集集团	15,016,885.84	7.77
21	603589	口子窖	14,627,811.14	7.56
22	600884	杉杉股份	14,324,436.92	7.41
23	000078	海王生物	14,125,627.75	7.31
24	600201	生物股份	13,686,997.35	7.08
25	600511	国药股份	13,570,525.98	7.02

26	603369	今世缘	13,527,850.22	7.00
27	601233	桐昆股份	13,490,720.91	6.98
28	000778	新兴铸管	13,465,115.00	6.96
29	002013	中航机电	13,225,860.73	6.84
30	600240	华业资本	13,203,913.60	6.83
31	002589	瑞康医药	13,137,037.00	6.79
32	600566	济川药业	12,869,722.72	6.66
33	002439	启明星辰	12,744,350.40	6.59
34	600859	王府井	12,653,776.19	6.54
35	002001	新 和 成	12,623,634.77	6.53
36	600256	广汇能源	12,439,298.40	6.43
37	000661	长春高新	12,370,600.20	6.40
38	600079	人福医药	12,190,359.00	6.30
39	000050	深天马 A	12,071,798.00	6.24
40	000667	美好置业	11,876,714.65	6.14
41	600056	中国医药	11,859,930.16	6.13
42	000998	隆平高科	11,802,273.00	6.10
43	600004	白云机场	11,767,289.49	6.09
44	002271	东方雨虹	11,736,195.90	6.07
45	000997	新 大 陆	11,562,897.33	5.98
46	002179	中航光电	11,288,062.88	5.84
47	002152	广电运通	11,042,319.00	5.71
48	002440	闰土股份	10,994,076.09	5.69
49	000937	冀中能源	10,974,871.00	5.68
50	000541	佛山照明	10,857,576.64	5.62
51	601006	大秦铁路	10,658,301.69	5.51
52	600655	豫园股份	10,657,214.47	5.51
53	002410	广联达	10,485,055.63	5.42
54	600729	重庆百货	10,416,314.60	5.39
55	000703	恒逸石化	10,349,440.60	5.35
56	600754	锦江股份	10,318,428.50	5.34

57	300088	长信科技	10,285,882.71	5.32
58	000977	浪潮信息	10,245,756.40	5.30
59	600885	宏发股份	10,054,454.67	5.20
60	600143	金发科技	10,008,760.64	5.18
61	601717	郑煤机	10,007,166.44	5.18
62	002032	苏泊尔	9,959,144.06	5.15
63	002191	劲嘉股份	9,887,948.70	5.11
64	601678	滨化股份	9,882,073.99	5.11
65	000990	诚志股份	9,823,105.42	5.08
66	000090	天健集团	9,790,011.00	5.06
67	600366	宁波韵升	9,700,248.10	5.02
68	000685	中山公用	9,684,450.00	5.01
69	600582	天地科技	9,668,500.46	5.00
70	600694	大商股份	9,627,325.16	4.98
71	600673	东阳光科	9,592,558.61	4.96
72	600900	长江电力	9,540,974.96	4.93
73	600633	浙数文化	9,494,841.00	4.91
74	002491	通鼎互联	9,478,656.00	4.90
75	600651	飞乐音响	9,205,351.74	4.76
76	300287	飞利信	9,108,806.93	4.71
77	002221	东华能源	9,083,412.32	4.70
78	600438	通威股份	9,071,656.53	4.69
79	000860	顺鑫农业	9,041,606.92	4.68
80	000400	许继电气	8,960,585.56	4.63
81	600094	大名城	8,872,480.97	4.59
82	600565	迪马股份	8,793,458.00	4.55
83	000513	丽珠集团	8,781,443.30	4.54
84	600557	康缘药业	8,709,138.30	4.50
85	000021	深科技	8,676,040.00	4.49
86	601168	西部矿业	8,643,259.00	4.47
87	000012	南玻 A	8,633,734.16	4.47

88	300133	华策影视	8,624,108.00	4.46
89	600808	马钢股份	8,441,567.83	4.37
90	002056	横店东磁	8,395,051.00	4.34
91	002416	爱施德	8,348,285.04	4.32
92	000596	古井贡酒	8,311,914.75	4.30
93	601231	环旭电子	8,304,599.82	4.29
94	000536	华映科技	8,234,824.29	4.26
95	002463	沪电股份	8,157,267.00	4.22
96	002503	搜于特	8,148,837.80	4.21
97	600600	青岛啤酒	8,145,149.85	4.21
98	600216	浙江医药	8,084,593.56	4.18
99	002268	卫士通	8,072,208.75	4.17
100	002127	南极电商	8,048,705.92	4.16
101	000027	深圳能源	8,023,755.90	4.15
102	000887	中鼎股份	7,967,526.40	4.12
103	600346	恒力股份	7,957,791.78	4.12
104	600277	亿利洁能	7,954,385.22	4.11
105	600466	蓝光发展	7,926,735.39	4.10
106	000552	靖远煤电	7,912,400.00	4.09
107	600572	康恩贝	7,887,676.40	4.08
108	600138	中青旅	7,887,316.78	4.08
109	600875	东方电气	7,868,840.00	4.07
110	000902	新洋丰	7,850,489.00	4.06
111	300383	光环新网	7,784,971.72	4.03
112	600269	赣粤高速	7,765,586.00	4.02
113	000066	中国长城	7,742,055.12	4.00
114	002019	亿帆医药	7,732,921.00	4.00
115	600195	中牧股份	7,731,775.10	4.00
116	600970	中材国际	7,702,710.42	3.98
117	002482	广田集团	7,691,695.47	3.98
118	002444	巨星科技	7,612,941.00	3.94

119	600486	扬农化工	7,554,486.08	3.91
120	600284	浦东建设	7,543,927.20	3.90
121	000488	晨鸣纸业	7,542,759.00	3.90
122	600835	上海机电	7,407,478.17	3.83
123	600266	北京城建	7,372,332.08	3.81
124	000598	兴蓉环境	7,350,597.00	3.80
125	600260	凯乐科技	7,270,110.57	3.76
126	600801	华新水泥	7,240,436.00	3.74
127	603766	隆鑫通用	7,234,587.12	3.74
128	002223	鱼跃医疗	7,225,881.50	3.74
129	000848	承德露露	7,211,256.00	3.73
130	600395	盘江股份	7,175,902.21	3.71
131	002051	中工国际	7,088,228.36	3.67
132	000926	福星股份	7,038,308.00	3.64
133	000656	金科股份	7,023,562.00	3.63
134	002064	华峰氨纶	7,022,685.00	3.63
135	000830	鲁西化工	6,933,551.00	3.59
136	002176	江特电机	6,911,849.80	3.57
137	600282	南钢股份	6,860,308.17	3.55
138	000501	鄂武商 A	6,856,288.84	3.55
139	002038	双鹭药业	6,850,770.01	3.54
140	600611	大众交通	6,832,741.50	3.53
141	000969	安泰科技	6,825,710.35	3.53
142	600881	亚泰集团	6,818,803.00	3.53
143	000030	富奥股份	6,795,242.17	3.51
144	600236	桂冠电力	6,734,952.80	3.48
145	000718	苏宁环球	6,706,272.40	3.47
146	600578	京能电力	6,701,242.84	3.47
147	000612	焦作万方	6,676,247.48	3.45
148	002277	友阿股份	6,656,597.04	3.44
149	600580	卧龙电气	6,613,653.47	3.42

150	600718	东软集团	6,589,142.09	3.41
151	002233	塔牌集团	6,587,036.00	3.41
152	300055	万邦达	6,543,153.00	3.38
153	600141	兴发集团	6,541,000.56	3.38
154	002518	科士达	6,513,397.85	3.37
155	600748	上实发展	6,505,857.36	3.36
156	600863	内蒙华电	6,490,715.76	3.36
157	600548	深高速	6,448,451.20	3.33
158	600348	阳泉煤业	6,432,537.17	3.33
159	002299	圣农发展	6,389,980.86	3.30
160	600315	上海家化	6,325,745.64	3.27
161	000999	华润三九	6,306,749.31	3.26
162	000975	银泰资源	6,266,527.00	3.24
163	000818	航锦科技	6,234,833.00	3.22
164	300026	红日药业	6,156,922.00	3.18
165	600219	南山铝业	6,097,770.00	3.15
166	000543	皖能电力	6,091,162.44	3.15
167	300039	上海凯宝	6,027,557.70	3.12
168	600169	太原重工	5,987,569.00	3.10
169	000761	本钢板材	5,954,296.00	3.08
170	002304	洋河股份	5,895,830.00	3.05
171	601222	林洋能源	5,840,022.50	3.02
172	600743	华远地产	5,832,225.09	3.02
173	603328	依顿电子	5,801,380.47	3.00
174	600639	浦东金桥	5,796,331.74	3.00
175	000528	柳工	5,676,913.85	2.94
176	002603	以岭药业	5,673,753.76	2.93
177	600750	江中药业	5,651,682.97	2.92
178	000636	风华高科	5,606,664.80	2.90
179	600787	中储股份	5,600,700.78	2.90
180	000089	深圳机场	5,570,161.00	2.88

181	600298	安琪酵母	5,563,105.12	2.88
182	000028	国药一致	5,562,863.03	2.88
183	600585	海螺水泥	5,532,315.18	2.86
184	600317	营口港	5,495,893.00	2.84
185	600894	广日股份	5,432,689.64	2.81
186	002004	华邦健康	5,402,412.00	2.79
187	600623	华谊集团	5,394,075.12	2.79
188	300202	聚龙股份	5,381,900.50	2.78
189	000988	华工科技	5,376,358.52	2.78
190	002635	安洁科技	5,348,462.69	2.77
191	600584	长电科技	5,332,177.50	2.76
192	300297	蓝盾股份	5,329,822.00	2.76
193	601699	潞安环能	5,266,201.02	2.72
194	600757	长江传媒	5,209,626.99	2.69
195	600151	航天机电	5,198,557.50	2.69
196	600028	中国石化	5,135,739.00	2.66
197	000519	中兵红箭	5,123,861.00	2.65
198	601311	骆驼股份	5,099,762.71	2.64
199	002340	格林美	5,099,588.41	2.64
200	600674	川投能源	5,084,439.31	2.63
201	600837	海通证券	5,050,782.00	2.61
202	000727	华东科技	5,032,761.00	2.60
203	603658	安图生物	5,005,003.12	2.59
204	601567	三星医疗	4,977,015.69	2.57
205	600325	华发股份	4,965,441.54	2.57
206	600657	信达地产	4,873,150.52	2.52
207	000547	航天发展	4,848,970.80	2.51
208	002640	跨境通	4,846,535.92	2.51
209	000563	陕国投 A	4,823,392.92	2.49
210	002396	星网锐捷	4,816,575.60	2.49
211	002025	航天电器	4,805,986.32	2.49

212	000158	常山北明	4,804,032.10	2.48
213	600017	日照港	4,784,142.90	2.47
214	000960	锡业股份	4,760,599.49	2.46
215	000652	泰达股份	4,728,872.00	2.45
216	600597	光明乳业	4,697,854.11	2.43
217	600978	宜华生活	4,685,482.00	2.42
218	600037	歌华有线	4,677,507.47	2.42
219	600811	东方集团	4,676,711.00	2.42
220	600270	外运发展	4,654,394.00	2.41
221	002048	宁波华翔	4,653,884.00	2.41
222	300159	新研股份	4,620,572.85	2.39
223	000426	兴业矿业	4,590,769.50	2.37
224	300113	顺网科技	4,590,028.00	2.37
225	600126	杭钢股份	4,569,106.39	2.36
226	603025	大豪科技	4,548,151.83	2.35
227	603288	海天味业	4,535,481.00	2.35
228	600267	海正药业	4,495,838.06	2.33
229	300114	中航电测	4,472,417.22	2.31
230	600335	国机汽车	4,450,748.00	2.30
231	600872	中炬高新	4,442,520.00	2.30
232	600098	广州发展	4,418,728.60	2.29
233	002073	软控股份	4,344,803.35	2.25
234	002358	森源电气	4,302,198.00	2.22
235	603001	奥康国际	4,285,183.20	2.22
236	600522	中天科技	4,250,209.00	2.20
237	002093	国脉科技	4,245,851.00	2.20
238	000729	燕京啤酒	4,173,861.00	2.16
239	000006	深振业 A	4,169,903.00	2.16
240	601088	中国神华	4,159,334.22	2.15
241	002063	远光软件	4,134,495.79	2.14
242	600777	新潮能源	4,058,016.96	2.10

243	002373	千方科技	4,052,352.59	2.10
244	601107	四川成渝	4,046,989.46	2.09
245	000009	中国宝安	4,033,293.85	2.09
246	000895	双汇发展	3,997,596.00	2.07
247	600688	上海石化	3,979,701.00	2.06
248	300257	开山股份	3,979,406.00	2.06
249	600170	上海建工	3,973,669.00	2.06
250	600664	哈药股份	3,970,283.00	2.05
251	600519	贵州茅台	3,882,393.00	2.01
252	002266	浙富控股	3,869,843.00	2.00

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

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	3,253,280,146.87
卖出股票收入(成交)总额	3,077,389,077.44

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	17,043,849.30	4.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,570.00	0.04
	其中:政策性金融债	150,570.00	0.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	17,194,419.30	5.01
----	----	---------------	------

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	019579	17国债24	108,190	10,835,228.50	3.16
2	019571	17国债17	62,080	6,208,620.80	1.81
3	018005	国开1701	1,500	150,570.00	0.04

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 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	161,712.39
2	应收证券清算款	2,414,949.28
3	应收股利	-
4	应收利息	446,198.88
5	应收申购款	804,943.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,827,804.24

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000415	渤海金控	933,816.00	0.27	重大事项停牌

§ 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

份额级别	持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证500增强A	6,623	39,899.41	234,938,901.68	88.91%	29,314,892.42	11.09%
创金合信中证500增强C	5,118	21,706.17	77,667,434.55	69.91%	33,424,739.29	30.09%
合计	11,635	32,260.07	312,606,336.23	83.28%	62,739,631.71	16.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证500增强A	22,916.36	0.01%
	创金合信中证500增强C	127,976.82	0.12%
	合计	150,893.18	0.04%

8.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0
	创金合信中证500增强C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	2.66%	10,000,000.00	2.66%	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	2.66%	10,000,000.00	2.66%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
基金合同生效日(2015年12月31日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00

本报告期期初基金份额总额	177,986,119.86	9,386,823.33
本报告期基金总申购份额	142,520,036.86	141,277,383.78
减：本报告期基金总赎回份额	56,252,362.62	39,572,033.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	264,253,794.10	111,092,173.84

§ 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	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	

	量					
英大 证券	1	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	4,899,658,945.08	77.43%	1,569,780.21	74.73%	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	741,969,413.08	11.73%	311,418.98	14.82%	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	323,598,877.51	5.11%	103,589.56	4.93%	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-
安信 证券	2	362,458,735.24	5.73%	115,950.41	5.52%	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-

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招商证券，广发证券，中信建投证券，英大证券，安信证券，中泰证券、长江证券7家券商的13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
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	12,091,364.93	76.31%	1,500,000.00	6.10%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	3,754,400.50	23.69%	15,000,000.00	60.98%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	8,100,000.00	32.93%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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、证券日报	2018-01-02
2	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	公司官网、证券日报	2018-01-19
3	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加苏宁金融为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-01-29
4	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、证券日报	2018-02-10

5	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报	2018-02-13
6	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	公司官网、证券日报	2018-02-13
7	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、证券日报	2018-02-22
8	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告	公司官网、证券日报	2018-03-28
9	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
10	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
11	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
12	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
13	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017	公司官网、证券日报	2018-03-31

	年年度报告		
14	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	公司官网、证券日报	2018-03-31
15	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券日报	2018-04-02
16	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年第1季度报告	公司官网、证券日报	2018-04-19
17	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、证券日报	2018-04-27
18	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-05-17
19	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、证券日报	2018-05-24
20	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广发证券为代销机构暨参加广发证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券日报	2018-06-06
21	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、证券日报	2018-06-15
22	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、证券日报	2018-06-21
23	创金合信基金管理有限公司	公司官网、证券日报	2018-06-29

	关于旗下部分开放式基金增加恒泰证券为代销机构的公告		
--	---------------------------	--	--

§ 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	170,683,806.27	0.00	50,000,000.00	120,683,806.27	32.15%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

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