

创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）

2018 年年度报告

2018 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 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2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.4 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.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	70
§11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 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.....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	78
13.2 存放地点.....	78
13.3 查阅方式.....	78

§ 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	契约型定期开放式
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	010-66105799
	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	010-66105798
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5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5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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

注：本基金自2019年1月19日起信息披露报纸由《证券时报》、《中国证券报》变更为《证券时报》。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年07月07日（基金合同生效日）-2017年12月31日
本期已实现收益	-7,933,488.24	1,989,979.46
本期利润	-19,218,423.39	3,954,331.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0890	0.0183
本期加权平均净值利润率	-8.97%	1.81%
本期基金份额净值增长率	-8.74%	1.83%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配利润	-15,264,091.42	1,989,979.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0707	0.0092
期末基金资产净值	200,560,941.08	219,779,364.47
期末基金份额净值	0.9293	1.0183
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末
基金份额累计净值增长率	-7.07%	1.83%

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，上年度可比期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

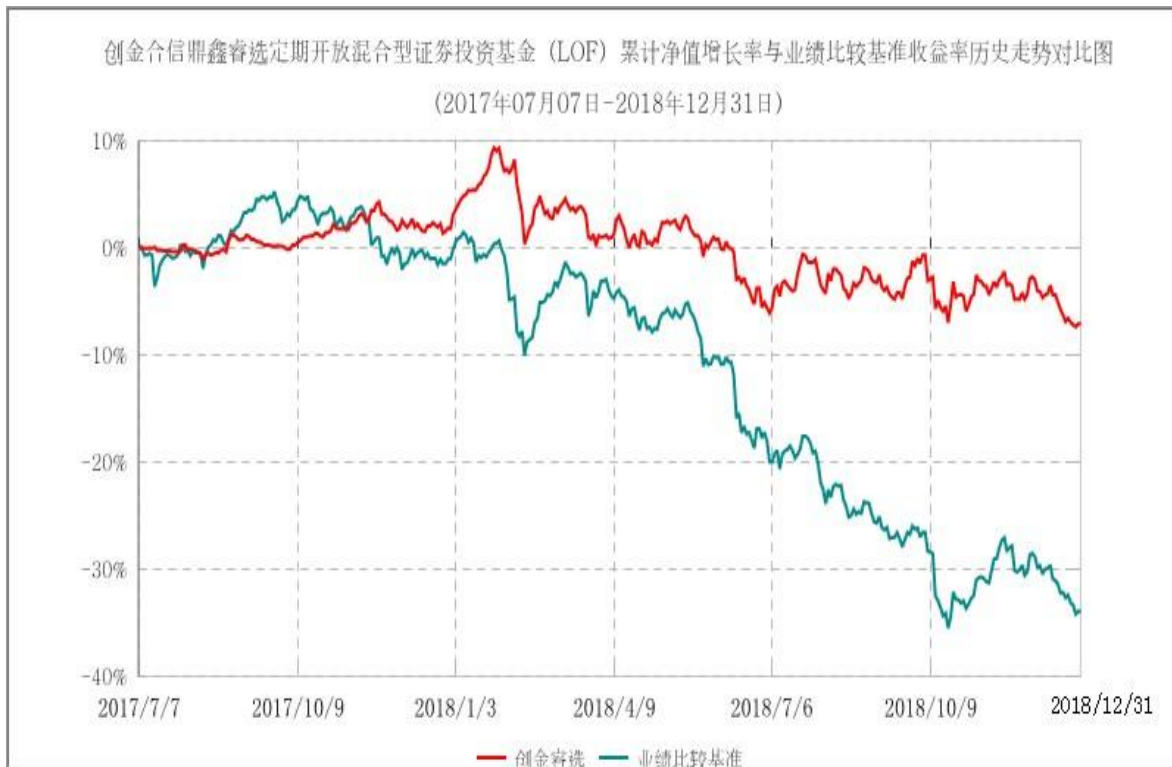
3.2 基金净值表现

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

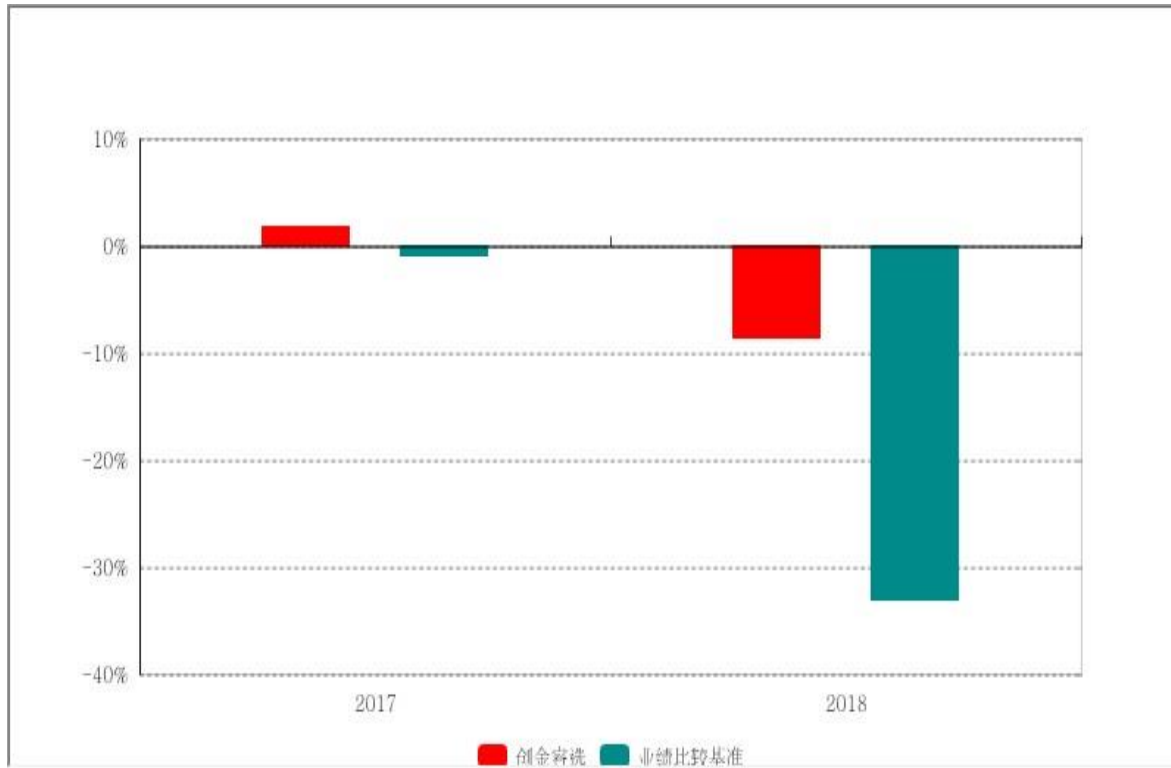
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-6.46%	0.93%	-10.01%	1.34%	3.55%	-0.41%
过去六个月	-3.46%	0.86%	-20.49%	1.15%	17.03%	-0.29%
过去一年	-8.74%	0.81%	-33.21%	1.09%	24.47%	-0.28%
自基金合同生效起至今	-7.07%	0.68%	-33.88%	0.96%	26.81%	-0.28%

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



注：本基金的合同生效日为2017年7月7日，本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日(2017年7月7日)至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

报告期内，本公司共发行11只公募基金。截至2018年12月31日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品8只、债券型产品12只、股票型产品9只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约150.47亿元。

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		
曹春林	本基金基金经理	2017-07-07	2018-09-13	14年	曹春林先生，中国国籍，厦门大学经济学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作，2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作，成功操作了A股市场仅有的两例从二级市场收购并控股上市公司的案例，对上市公司的运作转型和并购重组有深刻的理解，擅长从实业的独特视角去看待资本市场，2010年4月加盟第一创业证券，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资部副总监。曾获《证券时报》“2013中国最佳财富管理机构评选”最佳资管产品经理；2014年获《中国基金报》“第一届中国最佳基金经理评选”三年期权益
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，作为公司上市代表任海南中商期

					<p>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。</p>
张荣	本基金基金经理	2017-07-10	-	8年	<p>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。</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、证券从业年限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遵规守信情况的说明

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。本基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

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

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间

窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，本基金与其他基金构成同日反向且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5次，与本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，外部中美贸易摩擦有所缓和，主要矛盾转移到内部矛盾中。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。明年政策预计将继续着力于稳增长，是宽政策之年。不过，预计政策刺激力度可能有限。12月刚召开的中央政治局会议确定了明年稳增长的总体工作方向，但“继续打好三大攻坚战”，即防风险、精准脱贫和环保。稳增长权重阶段性调升，但防风险的政策目标并未放弃。鉴于杠杆是金融风险的源头，因此，面对融资平台和国企在内的广义地方政府债务压力，以及房价泡沫化的制约，过往“地产+基建”的刺激模式将难以大幅实行。

固收方面，四季度债券市场行情走牛，收益率整体下行，期限利差和信用利差总体压缩，呈现牛平态势。1年AAA信用债小幅下行10bp，10年国开债明显下行56bp至3.64%左右。债市继续走牛的主要因素仍在于经济持续走弱，且货币政策维持中性偏宽的状态。一方面，中美贸易摩擦和美国经济短周期下行，构成中国经济的外部下行压力，而前期政策收紧导致的信用收缩未得到显著缓解，构成内部下行压力，因此经济持续偏弱，形成长端利率的下行动力；另一方面，稳增长的内生压力，打通货币政策传导机制推动信用恢复，需要货币政策利率维持相对偏宽松的环境。在资金中枢水平下移的环境下，短

端利率跟随下行，同时具备较好利差空间的优质信用债也成为市场加杠杆的选择，也压缩了信用利差。

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0.9293元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.74%，同期业绩比较基准收益率为-33.21%。

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，2019年债市利率趋于下行。一方面，经济缺乏有效的增长动力，刺激政策的力度和效果都将有限，也决定了宽信用不能快速有效回升；另一方面，货币政策持续偏宽构成债市的相对有利环境。但经济不失速、货币政策不会过度宽松，当前不高的无风险利率水平向下的空间并不大。从策略上来看，组合久期维持适中；持续便宜的资金成本下，套息操作仍是较好策略，从而可能继续压缩信用利差水平。鉴于当前低风险债券资产的绝对收益和利差水平均不高，2019年债券的整体预期回报将较2018年有明显降低。策略更适于维持不激进的均衡状态。宽货币向宽信用的继续转化，将整体改善信用基本面，信用债违约事件将减少；当前政策对真实经营的优质民企融资支持较大，市场偏见尚未显著改观，投资价值突出；公募城投债发生系统性违约概率仍极低，尤其是公益类城投债，而产业类城投则需谨慎；对于资质较差的企业，融资难以得到根本改善，信用风险依旧较高，需要维持谨慎。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

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

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

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

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

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

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

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

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

（9）建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第24813号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了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“创金合信鼎鑫睿选定开混合基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的

	<p>资产负债表，2018年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。（二）我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了创金合信鼎鑫睿选开混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于创金合信鼎鑫睿选开混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述，创金合信鼎鑫睿选开混合基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）拟在资产负债表日后清算创金合信鼎鑫睿选开混合基金的剩余资产。因此，上述创金合信鼎鑫睿选开混合基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
<p>其他事项</p>	
<p>其他信息</p>	
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重</p>

	<p>大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估创金合信鼎鑫睿选定开混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算创金合信鼎鑫睿选定开混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注7.4.2有关以清算基础编制财务报表的说明。基金管理人治理层负责监督创金合信鼎鑫睿选定开混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对创金合信鼎鑫睿选定开混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得</p>

	出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致创金合信鼎鑫睿选定期混合基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹翠丽、边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2019-03-14

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	68,702,115.06	3,064,306.58
结算备付金		3,332,877.17	5,178,800.15
存出保证金		14,966.88	46,680.22
交易性金融资产	7.4.7.2	138,776,089.71	388,343,892.85
其中：股票投资		98,219,367.71	111,360,612.45
基金投资		-	-

债券投资		40,556,722.00	276,983,280.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	335,821.98
应收利息	7.4.7.5	969,036.18	5,274,423.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		211,795,085.00	402,243,925.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	181,754,028.11
应付证券清算款		10,623,470.70	27,428.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		260,918.28	280,450.75
应付托管费		43,486.36	46,741.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	35,740.87	45,358.40
应交税费		6,896.11	-
应付利息		-868.40	161,053.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	264,500.00	149,500.00

负债合计		11,234,143.92	182,464,560.70
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	215,825,032.50	215,825,032.50
未分配利润	7.4.7.10	-15,264,091.42	3,954,331.97
所有者权益合计		200,560,941.08	219,779,364.47
负债和所有者权益总计		211,795,085.00	402,243,925.17

注：1. 报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.9293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，上年度可比期间为2017年7月7日至2017年12月31日。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日
一、收入		-10,730,731.98	8,683,346.49
1. 利息收入		7,502,852.34	5,447,526.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	110,891.57	94,421.46
债券利息收入		7,384,519.31	5,326,241.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,441.46	26,864.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,948,649.17	1,271,467.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,364,319.66	2,064,818.09

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,022,353.08	-1,086,355.55
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,438,023.57	293,004.51
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-11,284,935.15	1,964,352.51
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）		-	-
减：二、费用		8,487,691.41	4,729,014.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	3,216,395.95	1,586,213.93
2. 托管费	7.4.10.2. 2	536,065.95	264,368.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.17	576,228.66	116,360.27
5. 利息支出		3,859,950.99	2,609,241.62
其中：卖出回购金融资产 支出		3,859,950.99	2,609,241.62
6. 税金及附加		18,398.19	-
7. 其他费用	7.4.7.18	280,651.67	152,829.75
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-19,218,423.39	3,954,331.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-19,218,423.39	3,954,331.97

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，上年度可比期间为2017年7月7日至2017年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	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)	-	-19,218,423.39	-19,218,423.39
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	-15,264,091.42	200,560,941.08
项 目	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	215,825,033.02	-	215,825,033.02
二、本期经营活动产	-	3,954,331.97	3,954,331.97

生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-0.52	-	-0.52
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-0.52	-	-0.52
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	3,954,331.97	219,779,364.47

注：本基金合同生效日为2017年7月7日，上年度可比期间为2017年7月7日至2017年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信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]第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

《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，若该对应日的次日为非工作日或无该对应日，则该封闭期结束日顺延至下一工作日的前一日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至18个月后的对应日的期间，以此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所（以下简称“上交所”）转让基金份额。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生品（包括权证、股指期货等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的业绩比较基准为：中证定向增发事件指数收益率 \times 75%+中债总指数（全价）收益率 \times 25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

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》、基金管理人创金合信基金管理有限公司于2019年2月12日发布的《关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）触发基金合同终止情形的公告》及2019年2月19日发布的《关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2019年2月26日进入财产清算期，详情参见附注7.4.8.2资产负

债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于2018年12月31日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：（1）每一基金份额享有同等分配权；（2）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；（3）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统中的基金份额，基金份额持有人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，红利再投资的计算方法等有关事项遵循登记机构的相关规定；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统中的基金份额只能采取现金分红方式，基金份额持有人不能选择红利再投资；（4）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；（5）基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日；（6）法律法规或监管机关另有规定的，或证券交易所与登记机构的相关业务规则另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告

[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

本基金各项资产的可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	68,702,115.06	3,064,306.58
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	68,702,115.06	3,064,306.58

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		107,541,521.20	98,219,367.71	-9,322,153.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	14,304,709.60	14,317,722.00	13,012.40
	银行间市场	26,250,441.55	26,239,000.00	-11,441.55
	合计	40,555,151.15	40,556,722.00	1,570.85
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		148,096,672.35	138,776,089.71	-9,320,582.64
项目		上年度末2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		105,519,538.01	111,360,612.45	5,841,074.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	182,029,385.13	179,288,780.40	-2,740,604.73
	银行间市场	98,830,617.20	97,694,500.00	-1,136,117.20
	合计	280,860,002.33	276,983,280.40	-3,876,721.93
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		386,379,540.34	388,343,892.85	1,964,352.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	6,640.16	2,716.91
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	1,649.67	2,563.55
应收债券利息	960,738.98	5,269,119.83
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	7.37	23.10
合计	969,036.18	5,274,423.39

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	33,343.97	33,868.88
银行间市场应付交易费用	2,396.90	11,489.52
合计	35,740.87	45,358.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	264,500.00	149,500.00
合计	264,500.00	149,500.00

7.4.7.9 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12月31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。

7.4.7.10 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	-7,933,488.24	-11,284,935.15	-19,218,423.39
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	-5,943,508.78	-9,320,582.64	-15,264,091.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月0	上年度可比期间2017年07月07日
----	-------------	--------------------

	1日至2018年12月 31日	（基金合同生效日）至2017年12 月31日
活期存款利息收入	39,407.64	47,634.69
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	71,141.35	46,509.69
其他	342.58	277.08
合计	110,891.57	94,421.46

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
卖出股票成交总额	247,086,585.59	4,642,580.54
减：卖出股票成本总额	255,450,905.25	2,577,762.45
买卖股票差价收入	-8,364,319.66	2,064,818.09

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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2 018年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效 日）至2017年12月31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	-1,022,353.08	-1,086,355.55
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	-1,022,353.08	-1,086,355.55

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效日） 至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	330,749,612.65	156,098,794.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	322,757,133.72	152,221,345.16
减：应收利息总额	9,014,832.01	4,963,804.66
买卖债券差价收入	-1,022,353.08	-1,086,355.55

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,438,023.57	293,004.51
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,438,023.57	293,004.51

7.4.7.16 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20 18年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效日） 至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,284,935.15	1,964,352.51
——股票投资	-15,163,227.93	5,841,074.44

——债券投资	3,878,292.78	-3,876,721.93
——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	-11,284,935.15	1,964,352.51

7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	574,306.16	113,947.77
银行间市场交易费用	1,922.50	2,412.50
合计	576,228.66	116,360.27

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
审计费用	60,000.00	65,000.00
信息披露费	200,000.00	80,000.00
汇划手续费	2,651.67	1,429.75
账户维护费	18,000.00	6,400.00
合计	280,651.67	152,829.75

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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》、基金管理人创金合信基金管理有限公司于2019年2月12日发布的《关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)触发基金合同终止情形的公告》及2019年2月19日发布的《关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2019年2月26日进入财产清算程序。

7.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日 至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同 生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,216,395.95	1,586,213.93
其中：支付销售机构的客户维护费	613,721.46	337,199.46

注：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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日 至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生 效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	536,065.95	264,368.95

注：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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年07月07日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	68,702,115.06	39,407.64	3,064,306.58	47,634.69

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新发流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	125,800	2,187,926.95	2,014,058.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手和债券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（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	0.00
A-1以下	-	0.00
未评级	20,086,000.00	0.00
合计	20,086,000.00	0.00

7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	58,074,029.00
AAA以下	6,153,000.00	218,909,251.40
未评级	14,317,722.00	0.00

合计	20,470,722.00	276,983,280.40
----	---------------	----------------

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日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于开放期内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。

于2018年12月31日本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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。

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证券不得超过该证券的10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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%。于2018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1.03%。

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。

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；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018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	68,702,115.06	-	-	-	68,702,115.06

结算备付金	3,332,877.17	-	-	-	3,332,877.17
存出保证金	14,966.88	-	-	-	14,966.88
交易性金融资产	40,556,722.00	-	-	98,219,367.71	138,776,089.71
应收利息	-	-	-	969,036.18	969,036.18
资产总计	112,606,681.11	-	-	99,188,403.89	211,795,085.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,623,470.70	10,623,470.70
应付管理人报酬	-	-	-	260,918.28	260,918.28
应付托管费	-	-	-	43,486.36	43,486.36
应付交易费用	-	-	-	35,740.87	35,740.87
应交税费	-	-	-	6,896.11	6,896.11
应付利息	-	-	-	-868.40	-868.40
其他负债	-	-	-	264,500.00	264,500.00
负债总计	-	-	-	11,234,143.92	11,234,143.92
利率敏感度缺口	112,606,681.11	-	-	87,954,259.97	200,560,941.08
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	3,064,306.58	-	-	-	3,064,306.58

款					
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25个基点	-40,753.67	-548,478.86
市场利率下降25个基点	40,864.71	551,361.55	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31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	98,219,367.71	48.97	111,360,612.45	50.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	98,219,367.71	48.97	111,360,612.45	50.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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12月31日	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	4,210,290.73	2,451,195.76
	比较基准下降5%资产净值变动	-4,210,290.73	-2,451,195.76

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为96,155,163.91元，属于第二层次的余额为42,620,925.80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，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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12月31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) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	98,219,367.71	46.37
	其中：股票	98,219,367.71	46.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,556,722.00	19.15
	其中：债券	40,556,722.00	19.15
	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	72,034,992.23	34.01
8	其他各项资产	984,003.06	0.46
9	合计	211,795,085.00	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	641,478.00	0.32
B	采矿业	3,447,200.00	1.72
C	制造业	35,708,752.96	17.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,592,403.00	0.79
E	建筑业	4,318,903.00	2.15
F	批发和零售业	1,676,684.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	2,596,792.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,498,977.00	1.74
J	金融业	38,639,809.60	19.27
K	房地产业	4,210,786.00	2.10
L	租赁和商务服务业	507,237.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	27,838.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	222,696.15	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,506.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	910,418.00	0.45
S	综合	196,887.00	0.10

	合计	98,219,367.71	48.97
--	----	---------------	-------

8.3 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	172,000	9,649,200.00	4.81
2	600519	贵州茅台	8,100	4,779,081.00	2.38
3	600036	招商银行	164,500	4,145,400.00	2.07
4	601166	兴业银行	198,700	2,968,578.00	1.48
5	600016	民生银行	455,200	2,608,296.00	1.30
6	601328	交通银行	442,200	2,560,338.00	1.28
7	601288	农业银行	625,400	2,251,440.00	1.12
8	600887	伊利股份	97,200	2,223,936.00	1.11
9	600030	中信证券	125,800	2,014,058.00	1.00
10	601668	中国建筑	348,920	1,988,844.00	0.99
11	600276	恒瑞医药	37,200	1,962,300.00	0.98
12	600000	浦发银行	185,600	1,818,880.00	0.91
13	600104	上汽集团	55,600	1,482,852.00	0.74
14	601601	中国太保	51,000	1,449,930.00	0.72
15	600048	保利地产	113,500	1,338,165.00	0.67
16	601169	北京银行	235,600	1,321,716.00	0.66
17	601988	中国银行	355,800	1,284,438.00	0.64
18	601766	中国中车	117,400	1,058,948.00	0.53
19	601211	国泰君安	64,100	982,012.00	0.49
20	601229	上海银行	87,460	978,677.40	0.49
21	601818	光大银行	261,600	967,920.00	0.48
22	600585	海螺水泥	32,900	963,312.00	0.48
23	600019	宝钢股份	143,600	933,400.00	0.47
24	600028	中国石化	177,500	896,375.00	0.45
25	601688	华泰证券	53,000	858,600.00	0.43

26	601006	大秦铁路	103,100	848,513.00	0.42
27	600050	中国联通	158,700	820,479.00	0.41
28	600690	青岛海尔	58,200	806,070.00	0.40
29	601186	中国铁建	73,800	802,206.00	0.40
30	601857	中国石油	108,500	782,285.00	0.39
31	600309	万华化学	26,200	733,338.00	0.37
32	601390	中国中铁	89,100	622,809.00	0.31
33	601989	中国重工	146,100	620,925.00	0.31
34	601336	新华保险	14,000	591,360.00	0.29
35	601088	中国神华	31,700	569,332.00	0.28
36	601628	中国人寿	27,900	568,881.00	0.28
37	600999	招商证券	40,600	544,040.00	0.27
38	600340	华夏幸福	19,300	491,185.00	0.24
39	600879	航天电子	87,700	474,457.00	0.24
40	600958	东方证券	57,000	454,290.00	0.23
41	600811	东方集团	121,800	445,788.00	0.22
42	600703	三安光电	39,000	441,090.00	0.22
43	000581	威孚高科	24,541	433,394.06	0.22
44	600160	巨化股份	57,350	380,230.50	0.19
45	002195	二三四五	102,900	379,701.00	0.19
46	600606	绿地控股	61,700	376,987.00	0.19
47	600875	东方电气	47,500	374,775.00	0.19
48	600029	南方航空	55,500	368,520.00	0.18
49	601233	桐昆股份	37,400	365,024.00	0.18
50	600547	山东黄金	11,800	356,950.00	0.18
51	600642	申能股份	71,500	348,920.00	0.17
52	000778	新兴铸管	80,800	348,248.00	0.17
53	000960	锡业股份	36,400	347,256.00	0.17
54	600673	东阳光科	47,700	347,256.00	0.17
55	600183	生益科技	31,400	315,884.00	0.16
56	601000	唐山港	132,200	314,636.00	0.16

57	600649	城投控股	56,600	309,602.00	0.15
58	600111	北方稀土	34,900	306,073.00	0.15
59	600056	中国医药	23,800	299,166.00	0.15
60	002092	中泰化学	42,100	296,805.00	0.15
61	601168	西部矿业	50,900	296,238.00	0.15
62	600664	哈药股份	74,200	293,090.00	0.15
63	600839	四川长虹	126,000	291,060.00	0.15
64	002078	太阳纸业	50,000	285,000.00	0.14
65	000066	中国长城	59,500	282,030.00	0.14
66	600062	华润双鹤	23,300	281,697.00	0.14
67	002152	广电运通	49,600	278,256.00	0.14
68	601800	中国交建	24,300	273,618.00	0.14
69	601179	中国西电	79,400	266,784.00	0.13
70	600572	康恩贝	43,400	257,362.00	0.13
71	600582	天地科技	75,200	257,184.00	0.13
72	600017	日照港	90,300	249,228.00	0.12
73	600022	山东钢铁	154,400	242,408.00	0.12
74	601717	郑煤机	43,400	240,002.00	0.12
75	000926	福星股份	38,600	236,232.00	0.12
76	601928	凤凰传媒	29,700	235,818.00	0.12
77	002233	塔牌集团	23,100	232,386.00	0.12
78	002603	以岭药业	22,100	231,166.00	0.12
79	600598	北大荒	26,900	230,264.00	0.11
80	000156	华数传媒	28,800	228,384.00	0.11
81	600750	江中药业	13,300	225,169.00	0.11
82	600718	东软集团	19,400	224,070.00	0.11
83	601678	滨化股份	53,000	223,660.00	0.11
84	000592	平潭发展	81,800	218,406.00	0.11
85	000021	深科技	37,800	217,350.00	0.11
86	600021	上海电力	26,800	217,080.00	0.11
87	600936	广西广电	58,000	216,920.00	0.11

88	002373	千方科技	19,200	213,504.00	0.11
89	000738	航发控制	17,200	207,432.00	0.10
90	600755	厦门国贸	29,600	206,608.00	0.10
91	002400	省广集团	69,100	204,536.00	0.10
92	002223	鱼跃医疗	10,300	201,983.00	0.10
93	600565	迪马股份	77,300	200,980.00	0.10
94	601016	节能风电	85,300	197,896.00	0.10
95	000729	燕京啤酒	34,100	192,324.00	0.10
96	000988	华工科技	16,000	191,040.00	0.10
97	002317	众生药业	22,700	189,545.00	0.09
98	600748	上实发展	34,700	185,298.00	0.09
99	600300	维维股份	65,100	183,582.00	0.09
100	603198	迎驾贡酒	12,900	182,019.00	0.09
101	002276	万马股份	35,600	179,424.00	0.09
102	002583	海能达	22,600	178,314.00	0.09
103	603328	依顿电子	18,000	178,200.00	0.09
104	600410	华胜天成	30,000	175,800.00	0.09
105	600064	南京高科	22,300	175,724.00	0.09
106	000990	诚志股份	14,400	172,944.00	0.09
107	002344	海宁皮城	38,000	172,900.00	0.09
108	000009	中国宝安	39,300	169,383.00	0.08
109	600580	卧龙电气	26,600	167,580.00	0.08
110	600037	歌华有线	19,500	167,505.00	0.08
111	300297	蓝盾股份	33,200	166,000.00	0.08
112	002244	滨江集团	41,100	163,578.00	0.08
113	601608	中信重工	60,900	158,340.00	0.08
114	000543	皖能电力	32,900	157,591.00	0.08
115	000536	华映科技	83,100	155,397.00	0.08
116	002642	荣之联	23,700	152,628.00	0.08
117	000598	兴蓉环境	37,400	150,722.00	0.08
118	600970	中材国际	27,400	149,878.00	0.07

119	300182	捷成股份	34,800	149,292.00	0.07
120	600395	盘江股份	29,100	145,791.00	0.07
121	002299	圣农发展	8,800	145,552.00	0.07
122	600098	广州发展	25,500	144,330.00	0.07
123	600633	浙数文化	17,700	144,255.00	0.07
124	600967	内蒙一机	13,800	143,520.00	0.07
125	600657	信达地产	36,500	143,445.00	0.07
126	002444	巨星科技	15,100	143,148.00	0.07
127	000825	太钢不锈	34,000	140,760.00	0.07
128	601881	中国银河	20,500	139,810.00	0.07
129	600316	洪都航空	14,000	138,460.00	0.07
130	603993	洛阳钼业	36,700	137,992.00	0.07
131	300002	神州泰岳	41,200	135,960.00	0.07
132	600600	青岛啤酒	3,900	135,954.00	0.07
133	600823	世茂股份	35,800	134,608.00	0.07
134	601360	三六零	6,600	134,442.00	0.07
135	600388	龙净环保	13,200	133,980.00	0.07
136	000656	金科股份	21,500	133,085.00	0.07
137	300088	长信科技	31,200	129,480.00	0.06
138	600266	北京城建	16,300	129,096.00	0.06
139	600511	国药股份	5,500	127,875.00	0.06
140	601801	皖新传媒	19,000	126,920.00	0.06
141	603369	今世缘	8,700	126,063.00	0.06
142	002093	国脉科技	17,100	124,659.00	0.06
143	600073	上海梅林	16,700	124,415.00	0.06
144	300039	上海凯宝	30,600	124,236.00	0.06
145	603899	晨光文具	4,100	124,025.00	0.06
146	600827	百联股份	14,600	123,370.00	0.06
147	600578	京能电力	41,600	121,888.00	0.06
148	600737	中粮糖业	16,500	121,440.00	0.06
149	601777	力帆股份	31,400	119,634.00	0.06

150	002342	巨力索具	36,000	119,160.00	0.06
151	000027	深圳能源	22,600	118,650.00	0.06
152	600584	长电科技	14,300	117,832.00	0.06
153	002589	瑞康医药	16,900	117,793.00	0.06
154	603885	吉祥航空	9,300	116,529.00	0.06
155	002588	史丹利	29,900	116,311.00	0.06
156	600426	华鲁恒升	9,500	114,665.00	0.06
157	002051	中工国际	10,300	114,124.00	0.06
158	002482	广田集团	19,700	114,063.00	0.06
159	300166	东方国信	11,000	113,960.00	0.06
160	002440	闰土股份	12,600	113,400.00	0.06
161	600350	山东高速	24,100	109,896.00	0.05
162	600292	远达环保	21,655	106,759.15	0.05
163	600881	亚泰集团	31,600	104,596.00	0.05
164	002179	中航光电	3,100	104,408.00	0.05
165	002600	领益智造	39,700	99,250.00	0.05
166	002254	泰和新材	9,100	98,644.00	0.05
167	300146	汤臣倍健	5,600	95,144.00	0.05
168	600525	长园集团	21,600	94,608.00	0.05
169	601311	骆驼股份	10,600	93,598.00	0.05
170	002004	华邦健康	20,200	93,122.00	0.05
171	000937	冀中能源	24,300	91,611.00	0.05
172	002818	富森美	4,400	91,476.00	0.05
173	600004	白云机场	8,900	89,445.00	0.04
174	600862	中航高科	15,900	89,040.00	0.04
175	603589	口子窖	2,500	87,675.00	0.04
176	002191	劲嘉股份	11,100	86,691.00	0.04
177	000999	华润三九	3,300	82,038.00	0.04
178	002332	仙琚制药	13,000	79,690.00	0.04
179	300315	掌趣科技	22,300	78,719.00	0.04
180	600717	天津港	11,100	78,477.00	0.04

181	601339	百隆东方	13,800	76,314.00	0.04
182	002399	海普瑞	3,300	76,065.00	0.04
183	002128	露天煤业	10,600	75,896.00	0.04
184	600522	中天科技	9,300	75,795.00	0.04
185	600325	华发股份	12,200	75,640.00	0.04
186	600416	湘电股份	14,600	75,336.00	0.04
187	000997	新大陆	5,100	74,664.00	0.04
188	000157	中联重科	20,400	72,624.00	0.04
189	600422	昆药集团	11,610	71,749.80	0.04
190	002540	亚太科技	15,500	71,610.00	0.04
191	002463	沪电股份	9,900	70,983.00	0.04
192	000761	本钢板材	21,000	70,560.00	0.04
193	600537	亿晶光电	24,900	70,467.00	0.04
194	002073	软控股份	15,500	70,215.00	0.04
195	600179	安通控股	10,500	69,825.00	0.03
196	600500	中化国际	10,200	69,768.00	0.03
197	002013	中航机电	10,600	69,006.00	0.03
198	000829	天音控股	12,300	69,003.00	0.03
199	002087	新野纺织	19,300	68,129.00	0.03
200	600327	大东方	16,400	67,568.00	0.03
201	600775	南京熊猫	8,300	67,313.00	0.03
202	000519	中兵红箭	10,600	66,674.00	0.03
203	002487	大金重工	19,900	66,466.00	0.03
204	601901	方正证券	12,500	66,375.00	0.03
205	600688	上海石化	13,300	66,367.00	0.03
206	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.03
207	000623	吉林敖东	4,500	64,935.00	0.03
208	600475	华光股份	7,900	64,780.00	0.03
209	600060	海信电器	7,300	63,364.00	0.03
210	000166	申万宏源	15,500	63,085.00	0.03
211	600863	内蒙华电	26,900	62,139.00	0.03

212	601018	宁波港	18,300	61,122.00	0.03
213	600466	蓝光发展	11,300	60,794.00	0.03
214	601966	玲珑轮胎	4,400	60,060.00	0.03
215	002416	爱施德	10,000	58,800.00	0.03
216	600757	长江传媒	8,900	58,028.00	0.03
217	002663	普邦股份	23,300	57,551.00	0.03
218	600741	华域汽车	3,100	57,040.00	0.03
219	600971	恒源煤电	10,000	56,300.00	0.03
220	600894	广日股份	10,300	56,135.00	0.03
221	000404	长虹华意	14,300	55,198.00	0.03
222	600320	振华重工	17,400	55,158.00	0.03
223	000701	厦门信达	9,100	55,146.00	0.03
224	600171	上海贝岭	5,900	55,106.00	0.03
225	600563	法拉电子	1,300	54,782.00	0.03
226	600059	古越龙山	8,300	54,780.00	0.03
227	002533	金杯电工	12,400	54,684.00	0.03
228	601518	吉林高速	21,100	54,438.00	0.03
229	600279	重庆港九	13,900	54,349.00	0.03
230	002613	北玻股份	20,200	53,732.00	0.03
231	300303	聚飞光电	22,000	53,460.00	0.03
232	002566	益盛药业	9,300	53,382.00	0.03
233	600222	太龙药业	15,700	53,380.00	0.03
234	601600	中国铝业	14,700	52,185.00	0.03
235	600667	太极实业	10,000	51,100.00	0.03
236	300194	福安药业	15,800	50,718.00	0.03
237	601811	新华文轩	5,400	50,274.00	0.03
238	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.03
239	603309	维力医疗	5,200	49,920.00	0.02
240	002461	珠江啤酒	11,000	48,400.00	0.02
241	600835	上海机电	3,300	48,015.00	0.02
242	600216	浙江医药	5,500	47,740.00	0.02

243	002176	江特电机	8,100	47,547.00	0.02
244	600108	亚盛集团	17,900	47,256.00	0.02
245	002353	杰瑞股份	3,100	46,500.00	0.02
246	002563	森马服饰	5,200	46,384.00	0.02
247	600820	隧道股份	7,200	45,072.00	0.02
248	002538	司尔特	9,300	44,919.00	0.02
249	600706	曲江文旅	4,400	44,748.00	0.02
250	000566	海南海药	8,700	44,544.00	0.02
251	600623	华谊集团	5,500	44,440.00	0.02
252	000776	广发证券	3,500	44,380.00	0.02
253	600873	梅花生物	10,500	44,310.00	0.02
254	601126	四方股份	8,700	44,283.00	0.02
255	002375	亚厦股份	8,700	43,848.00	0.02
256	002106	莱宝高科	7,100	43,026.00	0.02
257	601669	中国电建	8,800	42,768.00	0.02
258	603123	翠微股份	7,200	42,480.00	0.02
259	600643	爱建集团	5,000	42,450.00	0.02
260	000851	高鸿股份	8,900	42,364.00	0.02
261	601878	浙商证券	5,800	42,108.00	0.02
262	600859	王府井	3,100	42,036.00	0.02
263	000919	金陵药业	6,700	42,009.00	0.02
264	002426	胜利精密	18,100	41,992.00	0.02
265	000727	华东科技	28,500	41,895.00	0.02
266	300287	飞利信	11,000	41,580.00	0.02
267	600126	杭钢股份	9,200	41,492.00	0.02
268	002060	粤水电	15,100	41,072.00	0.02
269	002296	辉煌科技	8,000	40,800.00	0.02
270	002745	木林森	3,600	40,644.00	0.02
271	300360	炬华科技	6,200	40,610.00	0.02
272	600195	中牧股份	3,800	40,432.00	0.02
273	002022	科华生物	4,300	40,334.00	0.02

274	002688	金河生物	9,000	40,140.00	0.02
275	002242	九阳股份	2,500	40,025.00	0.02
276	600353	旭光股份	10,000	39,900.00	0.02
277	000716	黑芝麻	14,300	39,897.00	0.02
278	601588	北辰实业	14,700	39,837.00	0.02
279	601908	京运通	12,500	39,375.00	0.02
280	600513	联环药业	6,600	39,270.00	0.02
281	002788	鹭燕医药	3,100	39,122.00	0.02
282	600694	大商股份	1,600	38,704.00	0.02
283	002339	积成电子	6,300	38,556.00	0.02
284	601001	大同煤业	9,000	38,430.00	0.02
285	600790	轻纺城	10,500	38,325.00	0.02
286	601997	贵阳银行	3,500	37,380.00	0.02
287	600705	中航资本	8,800	37,312.00	0.02
288	600776	东方通信	3,200	36,704.00	0.02
289	600153	建发股份	5,200	36,660.00	0.02
290	600594	益佰制药	6,600	36,432.00	0.02
291	600282	南钢股份	10,600	36,252.00	0.02
292	000703	恒逸石化	3,000	34,560.00	0.02
293	600006	东风汽车	9,500	34,200.00	0.02
294	001696	宗申动力	7,800	34,008.00	0.02
295	600105	永鼎股份	8,400	32,424.00	0.02
296	300115	长盈精密	3,900	31,941.00	0.02
297	002561	徐家汇	4,000	30,800.00	0.02
298	600819	耀皮玻璃	7,400	30,266.00	0.02
299	601222	林洋能源	6,200	30,008.00	0.01
300	601107	四川成渝	8,600	29,928.00	0.01
301	002203	海亮股份	3,800	29,868.00	0.01
302	600674	川投能源	3,400	29,478.00	0.01
303	000032	深桑达A	4,100	28,782.00	0.01
304	603609	禾丰牧业	3,700	28,675.00	0.01

305	002546	新联电子	7,600	28,652.00	0.01
306	600020	中原高速	7,800	28,626.00	0.01
307	600033	福建高速	9,600	28,512.00	0.01
308	002308	威创股份	6,400	28,480.00	0.01
309	601369	陕鼓动力	4,700	28,435.00	0.01
310	600378	天科股份	3,200	28,416.00	0.01
311	601999	出版传媒	5,600	28,392.00	0.01
312	600592	龙溪股份	5,200	27,872.00	0.01
313	002398	建研集团	6,200	27,838.00	0.01
314	600269	赣粤高速	7,100	27,690.00	0.01
315	000807	云铝股份	7,100	27,548.00	0.01
316	600777	新潮能源	14,400	27,504.00	0.01
317	300217	东方电热	11,800	27,494.00	0.01
318	000488	晨鸣纸业	4,900	27,489.00	0.01
319	600271	航天信息	1,200	27,468.00	0.01
320	002029	七匹狼	4,400	27,280.00	0.01
321	002275	桂林三金	2,100	26,880.00	0.01
322	002171	楚江新材	5,800	26,854.00	0.01
323	600361	华联综超	7,900	26,781.00	0.01
324	000859	国风塑业	9,400	26,696.00	0.01
325	300330	华虹计通	3,800	26,562.00	0.01
326	002329	皇氏集团	8,100	26,325.00	0.01
327	600054	黄山旅游	2,800	26,264.00	0.01
328	000876	新希望	3,600	26,208.00	0.01
329	000059	华锦股份	4,400	26,136.00	0.01
330	601636	旗滨集团	6,600	25,080.00	0.01
331	000012	南玻A	6,060	24,179.40	0.01
332	002491	通鼎互联	3,000	23,640.00	0.01
333	002017	东信和平	2,500	23,275.00	0.01
334	002173	创新医疗	3,100	22,506.00	0.01
335	002020	京新药业	2,600	22,360.00	0.01

336	600235	民丰特纸	3,400	21,012.00	0.01
337	601998	中信银行	3,800	20,710.00	0.01
338	000686	东北证券	3,240	20,282.40	0.01
339	002083	孚日股份	4,000	19,720.00	0.01
340	600704	物产中大	4,300	19,694.00	0.01
341	600390	五矿资本	2,800	19,488.00	0.01
342	300197	铁汉生态	5,100	19,329.00	0.01
343	300050	世纪鼎利	3,100	19,251.00	0.01
344	603225	新凤鸣	900	16,875.00	0.01
345	300171	东富龙	2,400	16,824.00	0.01
346	002484	江海股份	2,700	16,632.00	0.01
347	600660	福耀玻璃	700	15,946.00	0.01
348	300175	朗源股份	3,800	15,770.00	0.01
349	600637	东方明珠	1,500	15,360.00	0.01
350	600886	国投电力	1,900	15,295.00	0.01
351	000908	景峰医药	3,400	15,096.00	0.01
352	600012	皖通高速	2,500	15,075.00	0.01
353	000702	正虹科技	2,700	15,012.00	0.01
354	600031	三一重工	1,800	15,012.00	0.01
355	600377	宁沪高速	1,500	14,700.00	0.01
356	002101	广东鸿图	1,800	14,562.00	0.01
357	600232	金鹰股份	2,900	14,500.00	0.01
358	603688	石英股份	1,300	14,300.00	0.01
359	600723	首商股份	2,300	14,283.00	0.01
360	600597	光明乳业	1,700	14,212.00	0.01
361	600336	澳柯玛	4,200	14,154.00	0.01
362	300196	长海股份	1,600	14,128.00	0.01
363	000420	吉林化纤	7,400	14,060.00	0.01
364	300150	世纪瑞尔	3,400	14,008.00	0.01
365	600170	上海建工	4,600	13,938.00	0.01
366	000529	广弘控股	3,100	13,888.00	0.01

367	002100	天康生物	3,300	13,860.00	0.01
368	300185	通裕重工	8,600	13,846.00	0.01
369	600189	吉林森工	3,700	13,801.00	0.01
370	600168	武汉控股	2,400	13,800.00	0.01
371	000301	东方盛虹	2,500	13,650.00	0.01
372	300275	梅安森	1,800	13,572.00	0.01
373	002298	中电兴发	2,300	13,570.00	0.01
374	600368	五洲交通	4,400	13,508.00	0.01
375	600237	铜峰电子	4,100	13,489.00	0.01
376	002303	美盈森	2,900	13,485.00	0.01
377	600051	宁波联合	2,500	13,475.00	0.01
378	600576	祥源文化	3,200	13,440.00	0.01
379	000850	华茂股份	4,200	13,440.00	0.01
380	300200	高盟新材	1,900	13,395.00	0.01
381	002736	国信证券	1,600	13,392.00	0.01
382	600628	新世界	2,100	13,314.00	0.01
383	600103	青山纸业	5,200	13,312.00	0.01
384	300363	博腾股份	1,500	13,290.00	0.01
385	600710	苏美达	3,600	13,284.00	0.01
386	600035	楚天高速	4,500	13,275.00	0.01
387	601677	明泰铝业	1,500	13,185.00	0.01
388	000965	天保基建	3,400	13,090.00	0.01
389	300255	常山药业	3,200	13,088.00	0.01
390	600731	湖南海利	3,100	13,082.00	0.01
391	000430	张家界	2,700	13,068.00	0.01
392	600218	全柴动力	2,900	13,050.00	0.01
393	600063	皖维高新	5,600	13,048.00	0.01
394	300354	东华测试	1,600	13,040.00	0.01
395	000862	银星能源	4,400	13,024.00	0.01
396	300231	银信科技	2,000	13,000.00	0.01
397	002392	北京利尔	4,000	12,800.00	0.01

398	000877	天山股份	1,800	12,798.00	0.01
399	600980	北矿科技	1,300	12,727.00	0.01
400	600850	华东电脑	800	12,616.00	0.01
401	002675	东诚药业	1,600	12,592.00	0.01
402	600015	华夏银行	1,700	12,563.00	0.01
403	300172	中电环保	2,400	12,528.00	0.01
404	002661	克明面业	1,000	12,340.00	0.01
405	601009	南京银行	1,900	12,274.00	0.01
406	000100	TCL集团	5,000	12,250.00	0.01
407	300408	三环集团	700	11,844.00	0.01
408	600686	金龙汽车	1,700	11,645.00	0.01
409	300442	普丽盛	910	11,529.70	0.01
410	601098	中南传媒	900	11,250.00	0.01
411	600893	航发动力	500	10,860.00	0.01
412	000596	古井贡酒	200	10,792.00	0.01
413	600125	铁龙物流	1,500	10,500.00	0.01
414	601117	中国化学	1,700	9,112.00	0.00
415	600184	光电股份	900	8,793.00	0.00
416	600551	时代出版	1,000	8,620.00	0.00
417	000425	徐工机械	2,500	8,075.00	0.00
418	300129	泰胜风能	2,300	6,578.00	0.00
419	000813	德展健康	700	6,426.00	0.00
420	002283	天润曲轴	1,900	6,365.00	0.00
421	002280	联络互动	1,600	6,192.00	0.00
422	000338	潍柴动力	600	4,620.00	0.00
423	600966	博汇纸业	1,100	3,454.00	0.00
424	600665	天地源	1,000	3,440.00	0.00
425	000159	国际实业	700	2,954.00	0.00
426	600163	中闽能源	500	1,590.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	2,496,281.46	1.14
2	600585	海螺水泥	1,976,306.00	0.90
3	002422	科伦药业	1,789,195.00	0.81
4	601006	大秦铁路	1,746,349.00	0.79
5	002038	双鹭药业	1,439,756.00	0.66
6	600511	国药股份	1,397,893.00	0.64
7	000039	中集集团	1,395,528.00	0.63
8	000999	华润三九	1,386,318.00	0.63
9	600056	中国医药	1,372,240.00	0.62
10	000078	海王生物	1,303,694.00	0.59
11	002078	太阳纸业	1,303,050.00	0.59
12	600062	华润双鹤	1,297,302.00	0.59
13	600019	宝钢股份	1,232,437.00	0.56
14	600309	万华化学	1,221,662.50	0.56
15	600600	青岛啤酒	1,194,909.38	0.54
16	000488	晨鸣纸业	1,193,761.00	0.54
17	000581	威孚高科	1,192,999.74	0.54
18	300182	捷成股份	1,187,720.00	0.54
19	601318	中国平安	1,182,701.00	0.54
20	600859	王府井	1,178,352.00	0.54

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002422	科伦药业	1,816,525.28	0.83

2	000999	华润三九	1,688,146.00	0.77
3	002589	瑞康医药	1,642,902.90	0.75
4	600062	华润双鹤	1,582,320.00	0.72
5	000732	泰禾集团	1,575,219.00	0.72
6	300182	捷成股份	1,566,064.00	0.71
7	600729	重庆百货	1,557,147.00	0.71
8	601006	大秦铁路	1,524,162.00	0.69
9	600056	中国医药	1,444,875.00	0.66
10	600837	海通证券	1,419,112.00	0.65
11	002179	中航光电	1,410,910.00	0.64
12	000667	美好置业	1,345,399.00	0.61
13	600195	中牧股份	1,336,153.00	0.61
14	002440	闰土股份	1,328,299.00	0.60
15	000039	中集集团	1,314,821.00	0.60
16	000786	北新建材	1,311,776.00	0.60
17	603589	口子窖	1,296,407.00	0.59
18	600270	外运发展	1,288,364.64	0.59
19	000581	威孚高科	1,253,695.00	0.57
20	600566	济川药业	1,246,710.00	0.57

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	257,472,888.44
卖出股票收入（成交）总额	247,086,585.59

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	34,403,722.00	17.15
	其中：政策性金融债	34,403,722.00	17.15
4	企业债券	6,153,000.00	3.07
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	40,556,722.00	20.22

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	180407	18农发07	200,000	20,086,000.00	10.01
2	018005	国开1701	142,550	14,317,722.00	7.14
3	1280315	12玉环交投债	300,000	6,153,000.00	3.07

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,966.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	969,036.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	984,003.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	2,014,058.00	1.00	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,994	108,237.23	103,678,855.29	48.04%	112,146,177.21	51.96%

9.2 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	谢西就	4,883,077.00	10.53
2	赵本营	4,499,800.00	9.71
3	朱群江	3,768,462.00	8.13
4	何燕	3,280,000.00	7.08
5	谢卓鹏	1,445,550.00	3.12
6	沈盛杰	1,198,200.00	2.58
7	麻炎平	1,000,000.00	2.16
8	林宇轩	990,999.00	2.14
9	陆鹿	950,935.00	2.05
10	东莞首富电子有限公司	869,958.00	1.88

9.3 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	48,075.33	0.02%

9.4 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
-----------------	------

§ 10 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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用60,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	612,642.90	0.12%	264.24	0.09%	-
平安证券	2	45,500,578.44	9.06%	32,804.86	11.66%	-
广州证券	2	90,143,495.95	17.96%	38,034.30	13.52%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

江海 证券	2	125,112.31	0.02%	53.95	0.02%	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	48,122,150.24	9.59%	15,435.11	5.49%	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	41,887,650.82	8.34%	17,596.10	6.26%	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	4,932,090.27	0.98%	3,591.83	1.28%	-
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	72,213,700.30	14.39%	30,417.30	10.81%	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
中投	2	-	-	-	-	-

证券						
银河证券	4	84,444,170.37	16.82%	60,854.69	21.64%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	113,990,688.18	22.71%	82,206.45	29.23%	-
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、安信证券、中金公司、江海证券、恒泰证券、太平洋证券、华创证券7家券商的14个交易单元，退租金元证券的2个交易单元。

11.7.2 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	10,081,238.35	3.56%	422,100,000.00	4.56%	-	-	-	-
平安证券	19,949,078.42	7.05%	222,332,000.00	2.40%	-	-	-	-
广州证	13,782,929.45	4.87%	1,297,100,000.00	14.03%	-	-	-	-

券								
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	221,000,000.00	2.39%	-	-	-	-
江海证券	126,859,003.88	44.85%	152,500,000.00	1.65%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	179,100,000.00	1.94%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	521,765.76	0.18%	286,850,000.00	3.10%	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	39,920,250.13	14.11%	1,139,600,000.00	12.32%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	294,000,000.00	3.18%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	968,600,000.00	10.47%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	190,700,000.00	2.06%	-	-	-	-
银河证券	29,415,301.70	10.40%	1,154,400,000.00	12.48%	-	-	-	-
中信证券	42,294,849.80	14.95%	94,000,000.00	1.02%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	2,469,660,000.00	26.70%	-	-	-	-

安信证 券	-	-	156,300,000.00	1.69%	-	-	-	-
----------	---	---	----------------	-------	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司 旗下基金资产净值公告	公司官网	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） 2017年第4季度报告	公司官网、中国证券报、证 券时报	2018-01-19
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、中国证券报、证 券时报	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（2 018年第1号）	公司官网、中国证券报、证 券时报	2018-02-14
5	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、中国证券报、证 券时报	2018-03-28
6	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、中国证券报、证 券时报	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） 托管协议（2018年3月修订）	公司官网、中国证券报、证 券时报	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） 招募说明书（更新）摘要（2 018年第1号）（2018年3月修 订）	公司官网、中国证券报、证 券时报	2018-03-28
9	创金合信基金管理有限公司	公司官网、中国证券报、证	2018-03-28

	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	券时报	
10	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	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-03-31
11	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、中国证券报、证券时报	2018-03-31
12	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、中国证券报、证券时报	2018-04-19
13	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、中国证券报、证券时报	2018-04-27
14	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、中国证券报、证券时报	2018-05-24
15	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、中国证券报、证券时报	2018-06-15
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、中国证券报、证券时报	2018-06-21
17	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	2018-07-02
18	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、中国证券报、证券时报	2018-07-03
19	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、中国证券报、证券时报	2018-07-20

	2018年第2季度报告		
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长量基金为代销机构的公告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-08-10
21	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2号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-08-20
22	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2号）招募说明书（摘要）	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-08-20
23	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	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-08-29
24	创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-09-14
25	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3季度报告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-10-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	201801 01 - 20 181231	90,007,100.0 0	0.00	0.00	90,007,10 0.00	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> <p>2、大额赎回风险</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信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 年年度报告。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 楼

13.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年三月二十九日