

**创金合信金融地产精选股票型证券投资基金（原创金合信
鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型）**

2018 年年度报告摘要

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本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。

基金托管人中国邮政储蓄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。

自 2018 年 10 月 11 日起，创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金正式变更为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，原创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 10 月 10 日止，创金合信金融地产精选股票型证券投资基金报告期自 2018 年 10 月 11 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介(转型后)

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------|---------------|
| 基金简称 | 创金合信金融地产精选股票 | |
| 基金主代码 | 003232 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年10月11日 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 8,522,275.06份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信金融地产精选股票A | 创金合信金融地产精选股票C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003232 | 003233 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,284,018.08份 | 3,238,256.98份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过对金融地产行业进行研究和分析，精选行业内具有核心竞争优势和持续成长潜力的上市公司，力争取得超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下的资产配置思路，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益、风险水平及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的具体分配比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证金融地产指数收益率*90%+人民币活期存款利率（税后）*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 梁绍锋 | 田东辉 |
| | 联系电话 | 0755-23838908 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | liangshaofeng@cjhxfund.com | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-0666 | 95580 |
| 传真 | | 0755-25832571 | 010-68858120 |

2.4 信息披露方式

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

§ 2 基金简介(转型前)

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------|-------------|
| 基金简称 | 创金合信鑫价值混合 | |
| 基金主代码 | 003232 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年08月30日 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,575,898.38份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003232 | 003233 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,297,530.56份 | 278,367.82份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 追求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架，基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法，综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素，形成各资产类别预期收益与预期风险的判断，并进而确定股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30% + 一年期人民币定期存款利率（税后）×70% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)

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10月11日（转型后首日） - 2018年12月31日 | |
|---------------|----------------------------------|---------------|
| | 创金合信金融地产精选股票A | 创金合信金融地产精选股票C |
| 本期已实现收益 | -73,808.21 | -45,887.93 |
| 本期利润 | -569,952.38 | -260,837.71 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1579 | -0.1211 |
| 本期基金份额净值增长率 | -25.78% | -25.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1794 | -0.1717 |
| 期末基金资产净值 | 3,921,337.52 | 2,400,141.16 |
| 期末基金份额净值 | 0.7421 | 0.7412 |

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

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣

除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 本基金由创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型而来, 基金转型生效日为2018年10月11日, 截至报告期末, 本基金成立不满一年。合同生效当期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

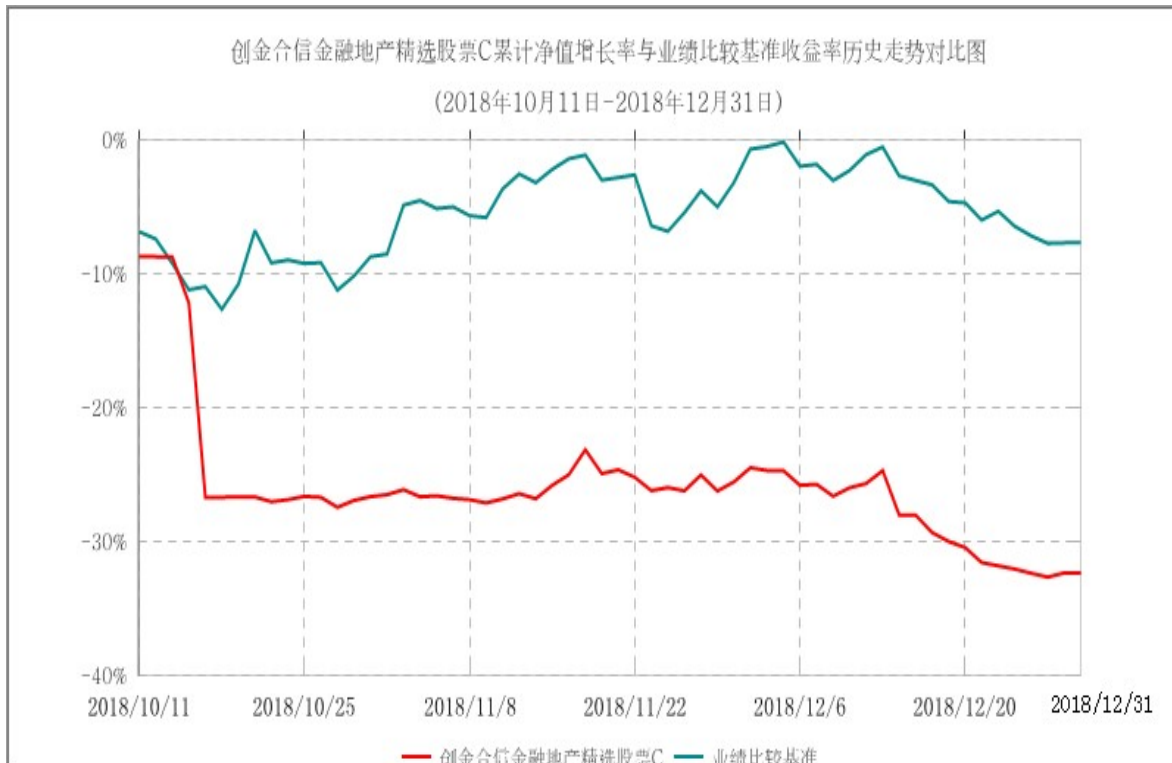
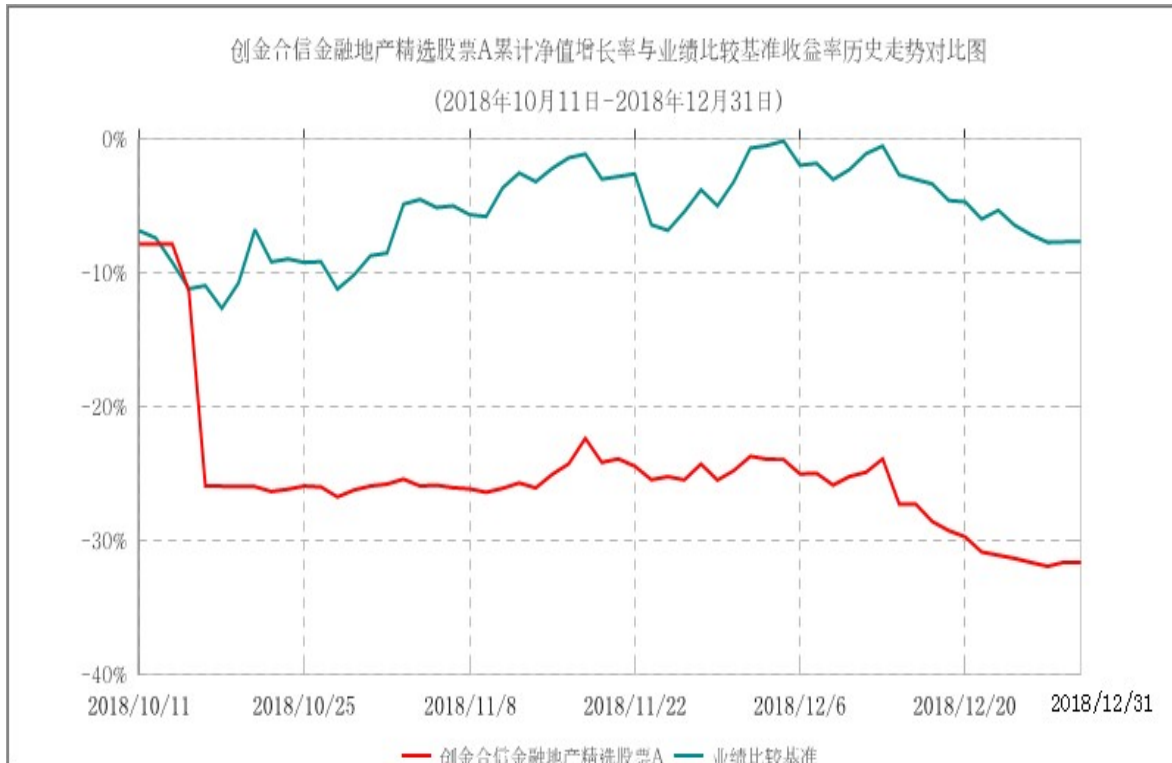
创金合信金融地产精选股票A

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -31.61% | 2.61% | -7.67% | 1.78% | -23.94% | 0.83% |

创金合信金融地产精选股票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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -32.34% | 2.66% | -7.67% | 1.78% | -24.67% | 0.88% |

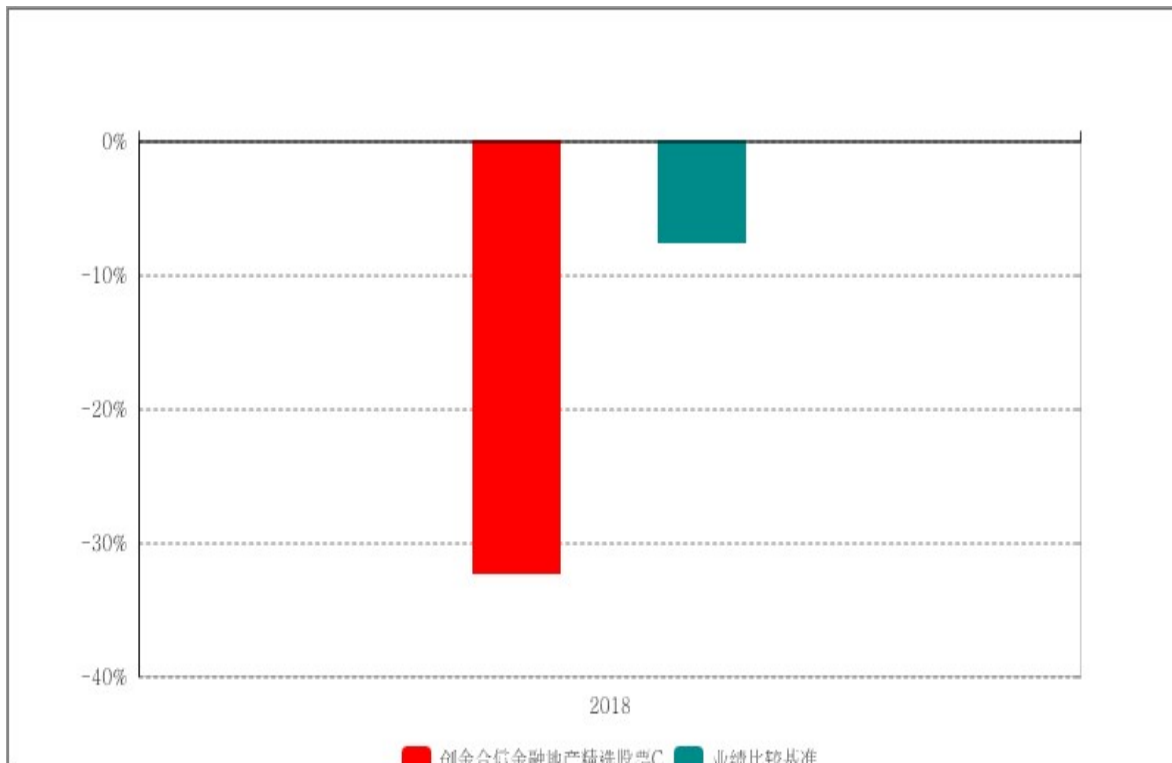
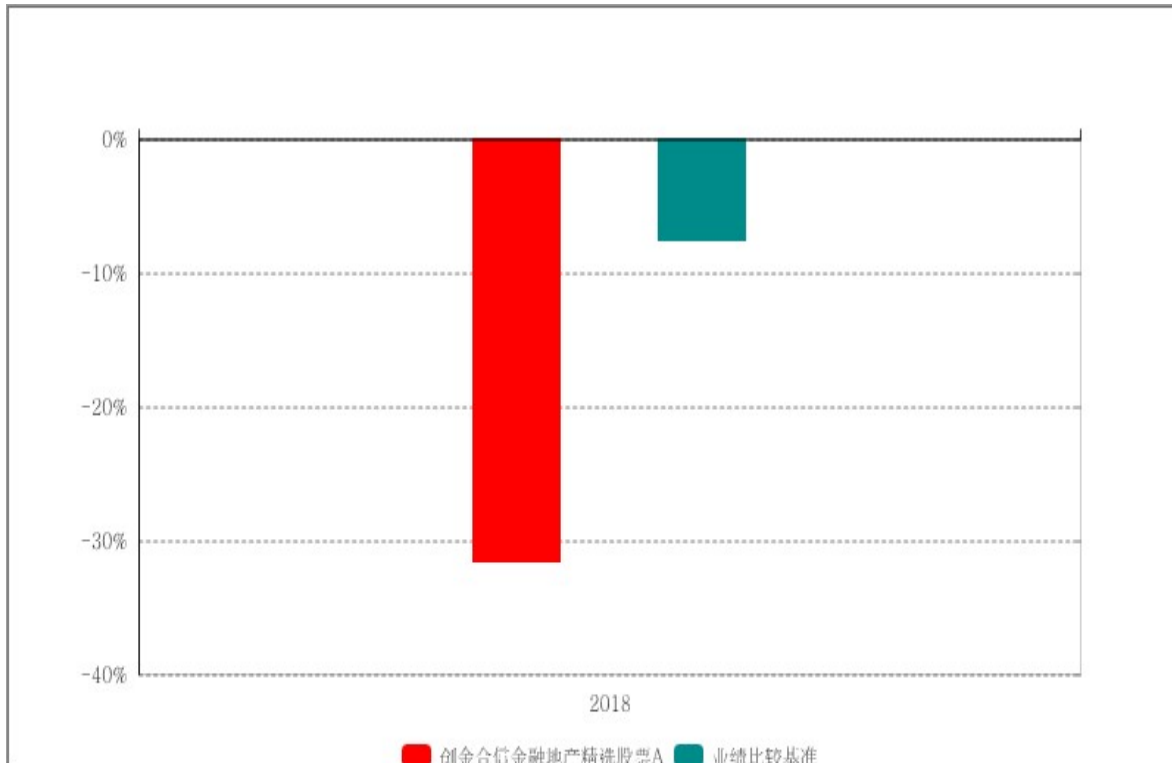
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金于 2018 年 10 月 11 日由创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型而来。截至报告期末，本基金转型不满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.2.3 自基金转型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（2018年10月11日）至本报告期末未发生利润分配。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

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10月10日) | | 2017年 | | 2016年08月30日（基金合同生效日）-2016年12月31日 | |
|---------------|------------------------------|------------|---------------|------------|----------------------------------|------------|
| | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C |
| 本期已实现收益 | -70,851.67 | -5,426.89 | 2,393,223.05 | 182,121.34 | 3,636,282.42 | 80.97 |
| 本期利润 | -155,027.79 | 3,993.27 | 11,898,693.26 | 192,175.84 | -6,090,574.93 | -171.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0677 | 0.0149 | 0.0377 | 0.1761 | -0.0076 | -0.0083 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.84% | 1.11% | 8.47% | 9.27% | -0.80% | -0.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年10月10日) | | 2017年末 | | 2016年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0775 | 0.0880 | 0.0764 | 0.0838 | -0.0076 | -0.0083 |
| 期末基金资产净值 | 1,408,096.45 | 304,965.01 | 4,296,075.81 | 294,408.77 | 793,996,607.24 | 20,628.58 |
| 期末基金份额净值 | 1.0850 | 1.0960 | 1.0760 | 1.0840 | 0.9920 | 0.9920 |

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。

3.2 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

创金合信鑫价值混合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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | - | - | -1.35% | 0.71% | 1.35% | -0.71% |
| 过去六个月 | 6.58% | 0.82% | -1.57% | 0.43% | 8.15% | 0.39% |
| 过去一年 | 0.84% | 0.77% | -4.90% | 0.38% | 5.74% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.50% | 0.52% | 2.51% | 0.28% | 5.99% | 0.24% |

创金合信鑫价值混合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 |
|---------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | - | 0.09% | -1.35% | 0.71% | 1.35% | -0.62% |
| 过去六个月 | 6.93% | 0.83% | -1.57% | 0.43% | 8.50% | 0.40% |
| 过去一年 | 1.11% | 0.77% | -4.90% | 0.38% | 6.01% | 0.39% |
| 自基金合同生效 | 9.60% | 0.53% | 2.51% | 0.28% | 7.09% | 0.25% |

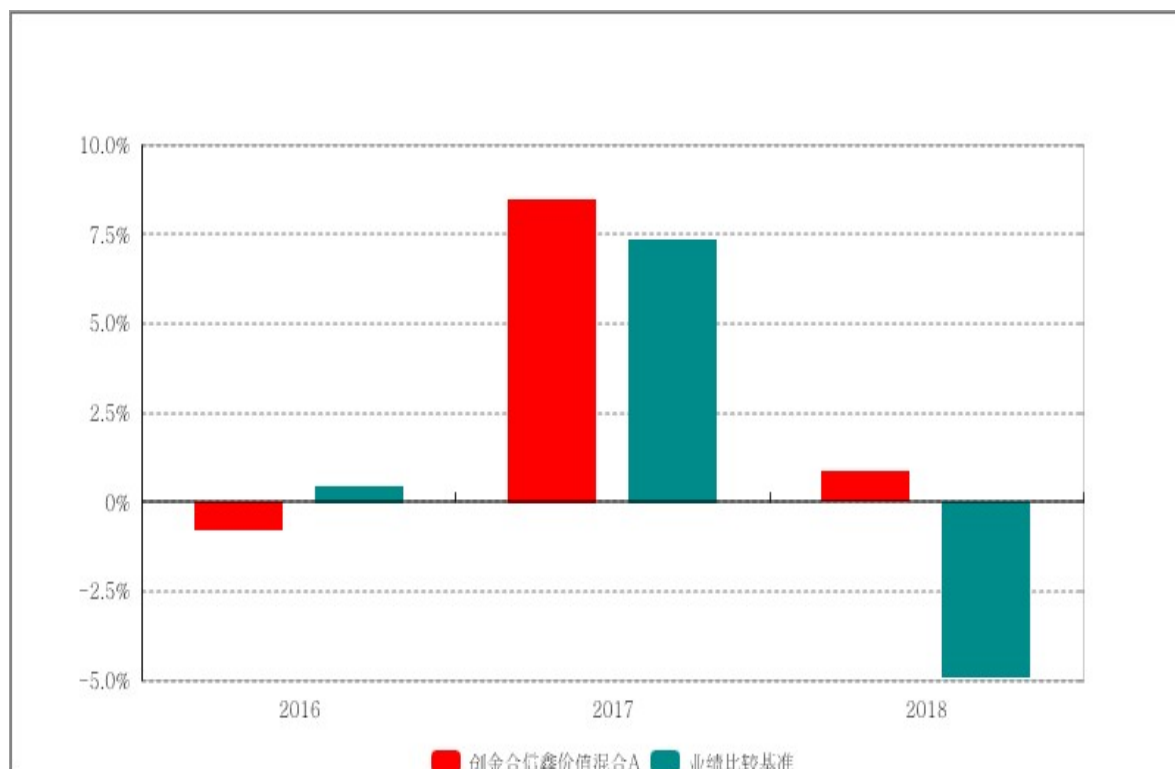
| | | | | | | |
|----------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至 今 | | | | | | |
|----------|--|--|--|--|--|--|

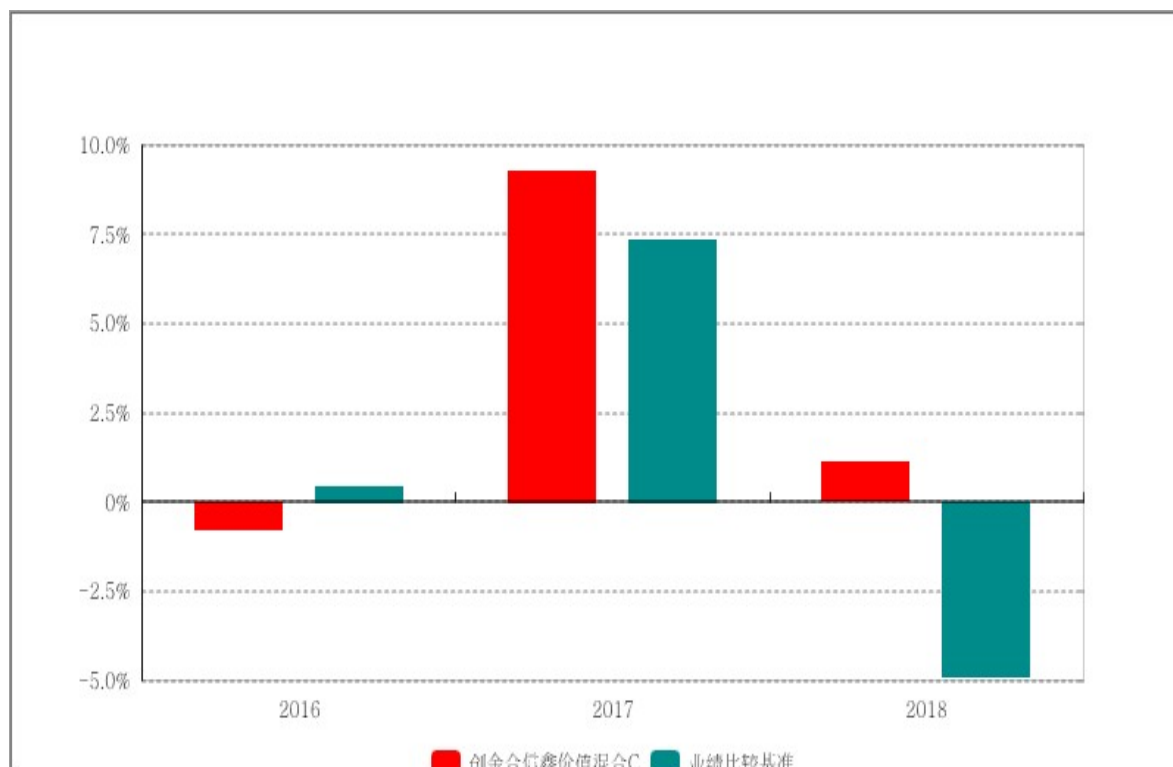
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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（2016年8月30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

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。

3、2018年10月11日创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，基金理由张荣、闫一帆变更为李龔。

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，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

本基金在2018年4季度完成转型，成为金融地产行业基金。整体而言，市场在2018年经历深度调整，金融地产板块估值处于历史底部区间，在不出现极端危机的前提下，金融板块ROE相对稳定，具备长期配置价值。整体货币环境和政策环境有利于对金融地产部分子板块较为有利，本基金将仓位主要配置在券商、地产、银行等板块龙头，并选择性配置保险龙头。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年10月10日，创金合信鑫价值混合A基金份额净值为1.0850元；自2018年1月1日至2018年10月10日本基金份额净值增长率为0.84%，同期业绩比较基准收益率为-4.90%。

截至2018年10月10日，创金合信鑫价值混合C基金份额净值为1.0960元；自2018年1月1日至2018年10月10日本基金份额净值增长率为1.11%，同期业绩比较基准收益率为4.90%。

截至2018年12月31日，创金合信金融地产精选股票A基金份额净值为0.7421元；自2018年10月11日至2018年12月31日本基金份额净值增长率为-31.61%，同期业绩比较基准收益率为-7.67%。

截至2018年12月31日，创金合信金融地产精选股票C基金份额净值为0.7412元；自2018年10月11日至2018年12月31日本基金份额净值增长率为-32.34%，同期业绩比较基准收益率为-7.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然2018年市场对宏观经济较为悲观，但2019年1月社融同比企稳回升，近几月基建投资单月同比增速转正，南华工业品指数走势较强，汽车零售等数据略有企稳，市场悲观预期略有修复。未来需要继续观察社融、地产销售、基建等数据情况，同时关注中美贸易谈判的最新进展。

证券市场2018年估值大幅下调，接近历史底部，在不发生系统性金融危机的前提下，多个板块体现出了明显的配置价值。2019年会是政策放松与基本面探底相互角力的一年，两者强度在阶段性体现不同，将会左右市场走势。

在近期市场利率下降的背景下，券商政策从严监管向创新转化正在不断进行，券商板块处于有利环境。地产行业销售回落和政策放松的节奏将影响股价走势。保险1月开门红负面影响已经反映在股价中，有望随着股权市场改善而迎来资产端改善。银行四季度业绩表现稳定，虽然未来面临息差下行的影响，但随着市场对于经济的预期从极度悲观回归理性，银行不良预期或略有改善。

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

创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金自2018年10月11日起，正式变更为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金。

本基金转型前，已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

本基金转型后，已出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，该情形发生的时间范围为2018年10月11日起，并延续至报告期末。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在创金合信金融地产精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告(转型后)

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 6 审计报告(转型前)

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2018年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 1,554,710.78 |
| 结算备付金 | 67,279.34 |
| 存出保证金 | 5,679.81 |
| 交易性金融资产 | 5,104,260.87 |
| 其中：股票投资 | 4,798,016.07 |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | 306,244.80 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收利息 | 9,918.45 |

| | |
|-----------------|--------------------|
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 849.02 |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 6,742,698.27 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年12月31日 |
| 负 债: | |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | - |
| 应付证券清算款 | 373,098.03 |
| 应付赎回款 | 1,889.95 |
| 应付管理人报酬 | 8,458.21 |
| 应付托管费 | 1,127.75 |
| 应付销售服务费 | 1,499.27 |
| 应付交易费用 | 15,146.60 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 19,999.78 |
| 负债合计 | 421,219.59 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 7,825,536.61 |
| 未分配利润 | -1,504,057.93 |
| 所有者权益合计 | 6,321,478.68 |
| 负债和所有者权益总计 | 6,742,698.27 |

注：1. 报告截止日2018年12月31日，基金份额总额8,522,275.06份，其中下属A类基金份额5,284,018.08份，C类基金份额3,238,256.98份。下属A类基金份额净值0.7421元，

C类基金份额净值0.7412元。

2、本基金由创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型而来，基金转型生效日为2018年10月11日，2018年度实际报告期间为2018年10月11日（基金转型生效日）至2018年12月31日。截止报告期末本基金转型未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

本报告期：2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 |
|-------------------|----------------------------------|
| 一、收入 | -780,732.77 |
| 1. 利息收入 | 3,946.21 |
| 其中：存款利息收入 | 1,985.84 |
| 债券利息收入 | 1,953.36 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 7.01 |
| 其他利息收入 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -74,702.31 |
| 其中：股票投资收益 | -83,650.41 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 162.30 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 8,785.80 |
| 3. 公允价值变动收益（损失） | -711,093.95 |

| | |
|-----------------------------|--------------------|
| 以“-”号填列) | |
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列) | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | 1,117.28 |
| 减：二、费用 | 50,057.32 |
| 1. 管理人报酬 | 15,729.76 |
| 2. 托管费 | 2,097.26 |
| 3. 销售服务费 | 2,737.17 |
| 4. 交易费用 | 24,998.70 |
| 5. 利息支出 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - |
| 6. 税金及附加 | - |
| 7. 其他费用 | 4,494.43 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | -830,790.09 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | -830,790.09 |

注：本基金由创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型而来，基金转型生效日为2018年10月11日，2018年度实际报告期间为2018年10月11日(基金转型生效日)至2018年12月31日。截止报告期末本基金转型未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：创金合信金融地产精选股票型证券投资基金

本报告期：2018年10月11日 (转型后首日) 至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 | | |
|-----|----------------------------------|-------|---------|
| | 2018年10月11日 (转型后首日) 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) | 1,575,898.38 | 137,163.08 | 1,713,061.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -830,790.09 | -830,790.09 |
| 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) | 6,249,638.23 | -810,430.92 | 5,439,207.31 |
| 其中：1. 基金申购款 | 6,742,725.36 | -829,432.24 | 5,913,293.12 |
| 2. 基金赎回款 | -493,087.13 | 19,001.32 | -474,085.81 |
| 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) | 7,825,536.61 | -1,504,057.93 | 6,321,478.68 |

注：本基金由创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型而来，基金转型生效日为2018年10月11日，2018年度实际报告期间为2018年10月11日(基金转型生效日)至2018年12月31日。截止报告期末本基金转型未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

创金合信金融地产精选股票型证券投资基金是由原创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“创金合信鑫价值混合基金”)转型而来。根据原创金合信鑫价值混合基金基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，创金合信鑫价值混合基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2018年9月27日发布了《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决

结果暨决议生效公告》。根据《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“中国邮政储蓄银行”）协商一致，自2018年10月11日起，原创金合信鑫价值混合基金名称变更为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行。

根据《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信金融地产精选股票型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（包括主板、中小板、创业板以及其他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、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单等）、权证、股指期货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：中证金融地产指数收益率 \times 90%+人民币活期存款利率（税后） \times 10%。

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》、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年10月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的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10月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年10月11日(基金合同生效日)至2018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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(2) 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；(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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、市净率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。

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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------|
| 创金合信基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮政储蓄银行”) | 基金托管人 |
| 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 |
| 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

单位: 人民币元

| 关联方名称 | 本期(转型后首日) 2018年10月11日至2018年12月31日 | |
|--------------|--------------------------------------|--------------|
| | 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 | 20,885,476.51 | 100.00% |

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 | |
|--------------|--------------------------------------|----------------|
| | 债券买卖成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 484,919.40 | 100.00% |

7.4.8.1.4 债券回购交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 | |
|--------------|--------------------------------------|----------------|
| | 债券回购成交金额 | 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 | 100,000.00 | 100.00% |

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（转型后首日） 2018年10月11日至2018年12月31日 | | | |
|--------------|--------------------------------------|----------------|--------------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付 佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 15,146.60 | 100.00% | 15,146.60 | 100.00% |

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| | |
|-----------------|--------------------------------|
| | 2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 15,729.76 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,156.63 |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人出具管理费划款指令，基金托管人复核无误后于次月前5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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| | |
|----------------|--------------------------------------|
| | 本期 2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,097.26 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人出具托管费划款指令，基金托管人复核无误后于次月前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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| | | | |
|----------------|--------------------------------------|------------|----|
| | 本期 2018年10月11日（转型后首日）至2018年12月31日 | | |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 创金合信金融地产精选 | 创金合信金融地产精选 | 合计 |

| | 股票A | 股票C | |
|----------------|--------------------------------|-------------------|-----------|
| 创金合信直销 | 0.00 | 2,341.03 | 2,341.03 |
| 合计 | 0.00 | 2,341.03 | 2,341.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 \$1yp2023至\$1yp2024 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 创金合信金融地产精选 股票A | 创金合信金融地产精选 股票C | 合计 |
| 创金合信直销 | 0.00 | 1.94 | 1.94 |
| 合计 | \$A1yp2112 | \$B1yp2112 | \$1yp2112 |

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.70%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人出具销售服务费划款指令，基金托管人复核无误后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信金融地产精选股票A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018年10月11日（ |
|----|--------------------|
| | |

| | |
|-------------------------------|---------------------|
| | 转型后首日) 至2018年12月31日 |
| 基金合同生效日 (2018年10月11日) 持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 2,890,605.53 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 |
| 减: 报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 2,890,605.53 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 54.70% |

创金合信金融地产精选股票C

份额单位: 份

| | |
|-------------------------------|----------------------------------------|
| 项目 | 本期 2018年10月11日 (转型后首日) 至2018年12月31日 |
| 基金合同生效日 (2018年10月11日) 持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 2,891,326.02 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 |
| 减: 报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 2,891,326.02 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 89.29% |

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

| | | |
|-------|----------------------------------------|--------|
| 关联方名称 | 本期 2018年10月11日 (转型后首日) 至2018年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |

| | | |
|----------------|--------------|----------|
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 1,554,710.78 | 1,883.19 |
|----------------|--------------|----------|

本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管,按银行同业存款利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 600030 | 中信证券 | 2018-12-25 | 重大事项停牌 | 16.01 | 2019-01-10 | 17.15 | 19,800 | 340,758.00 | 316,998.00 | - |
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大事项停牌 | 3.07 | - | - | 66,201 | 991,800.00 | 203,237.07 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年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4,277,781.00元，属于第二层次的余额为623,242.80元，属于第三层次的余额为203,237.07元。

(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

上述第三层次资产变动如下：期初的交易性金融资产权益工具投资金额为704,378.64元，当期利得或损失总额为-501,141.57元，截止2018年12月31日剩余金额为203,237.07元。2018年12月31日仍持有的资产计入2018年10月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间损益的未实现利得或损失的变动--公允价值变动损益的金额为-501,141.57元。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司净资产预期及市净率是不可观察输入值，故分类为第

三层级。如果相关证券的净资产预期及市净率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(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。

(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。

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年10月10日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018年10月10日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 712,549.75 | 196,937.61 |
| 结算备付金 | 3,157.89 | 1,363.64 |
| 存出保证金 | 395.08 | 35,428.67 |
| 交易性金融资产 | 1,005,578.64 | 3,054,444.70 |
| 其中：股票投资 | 704,378.64 | 913,710.00 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 301,200.00 | 2,140,734.70 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 1,400,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | 3,068.49 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收利息 | 7,278.98 | 13,134.96 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,728,960.34 | 4,704,378.07 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2018年10月10日 | 2017年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | 107.09 |
| 应付管理人报酬 | 282.40 | 2,361.94 |
| 应付托管费 | 94.16 | 787.31 |
| 应付销售服务费 | 16.97 | 53.67 |
| 应付交易费用 | - | 1,597.33 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 15,505.35 | 108,986.15 |
| 负债合计 | 15,898.88 | 113,893.49 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,575,898.38 | 4,262,821.83 |
| 未分配利润 | 137,163.08 | 327,662.75 |
| 所有者权益合计 | 1,713,061.46 | 4,590,484.58 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,728,960.34 | 4,704,378.07 |

注：1、报告截止日2018年10月10日，基金份额总额1,575,898.38份，其中下属A类基金份额1,297,530.56份，C类基金份额278,367.82份。下属A类基金份额净值1.085元，C类基金份额净值1.096元。

2、本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10日。

7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年10月10日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期2018年01月01日至2018年10月10日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 |
|-------------------|---------------------------|------------------------------------|
| 一、收入 | -117,256.30 | 17,245,957.90 |
| 1. 利息收入 | 27,091.48 | 14,567,012.93 |
| 其中：存款利息收入 | 4,132.72 | 118,455.63 |
| 债券利息收入 | 9,500.64 | 13,803,445.85 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 13,458.12 | 645,111.45 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -71,796.32 | -6,886,230.14 |
| 其中：股票投资收益 | -4,500.00 | 7,389,113.40 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -67,296.32 | -15,597,564.94 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | 1,322,221.40 |

| | | |
|----------------------------|--------------------|----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -74,755.96 | 9,515,524.71 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 2,204.50 | 49,650.40 |
| 减：二、费用 | 33,778.22 | 5,155,088.80 |
| 1. 管理人报酬 | 12,791.73 | 1,956,848.18 |
| 2. 托管费 | 4,264.01 | 652,282.74 |
| 3. 销售服务费 | 442.56 | 2,386.64 |
| 4. 交易费用 | 766.17 | 579,293.40 |
| 5. 利息支出 | - | 1,830,391.69 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | 1,830,391.69 |
| 6. 税金及附加 | 8.18 | - |
| 7. 其他费用 | 15,505.57 | 133,886.15 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -151,034.52 | 12,090,869.10 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -151,034.52 | 12,090,869.10 |

注：本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年10月10日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|---------------|-------------------------|------------|--------------|
| | 2018年01月01日至2018年10月10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 | 4,262,821.83 | 327,662.75 | 4,590,484.58 |

| | | | |
|----------------------------------------|-------------------------|---------------|-----------------|
| 值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -151,034.52 | -151,034.52 |
| 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) | -2,686,923.45 | -39,465.15 | -2,726,388.60 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 651,126.38 | 44,060.60 | 695,186.98 |
| 2. 基金赎回款 | -3,338,049.83 | -83,525.75 | -3,421,575.58 |
| 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) | 1,575,898.38 | 137,163.08 | 1,713,061.46 |
| 项 目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2017年01月01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) | 800,107,977.84 | -6,090,742.02 | 794,017,235.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 12,090,869.10 | 12,090,869.10 |
| 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) | -795,845,156.01 | -5,672,464.33 | -801,517,620.34 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 17,439,030.02 | 1,462,918.04 | 18,901,948.06 |
| 2. 基金赎回款 | -813,284,186.03 | -7,135,382.37 | -820,419,568.40 |
| 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) | 4,262,821.83 | 327,662.75 | 4,590,484.58 |

注：本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10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

创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(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]1933号《关于准予创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]1424号

《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《创金合信鑫价值灵活配置混合型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800,052,876.11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(2016)第1129号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为800,108,876.94份基金份额，其中认购资金利息折合56,000.83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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)。

根据《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据本基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2018年9月27日发布了《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据《关于创金合信鑫价值灵活配置混

合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国邮政储蓄银行协商一致，本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司将《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》分别修订为《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》，并已经中国证监会变更注册。《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》自2018年10月11日起生效，《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫价值灵活配置混合型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、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 \times 30%+一年期人民币定期存款利率(税后) \times 70%。

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》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，本基金基金管理人创金合信基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，存续期限不定，因此本基金财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年10月10日(基金合同失效前日)止期间的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10月10日(基金合同失效前日)的财务状况以及2018年1月1日至2018年10月10日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本基金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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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日前取得的基金、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基金份额净值、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 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------|
| 创金合信基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”） | 基金托管人 |
| 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 |
| 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（转型后首日） 2018年01月01日至2018 年10月10日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年1 2月31日 | |
|--------------|------------------------------------------|------------------|----------------------------------------|------------------|
| | 成交金 额 | 占当期股票成 交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成 交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 580,50 | 100.00% | 403,635, | 100.00% |

| | | | | |
|--|------|--|--------|--|
| | 0.00 | | 812.71 | |
|--|------|--|--------|--|

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年1 0月10日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日 | |
|--------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------------|------------------------|
| | 债券买卖 成交金额 | 占当期债券买 卖成交总额的 比例 | 成交金 额 | 占当期债券买 卖成交总额的 比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 2,111,66 6.34 | 100.00% | 68,160 ,064.1 0 | 100.00% |

7.4.8.1.4 债券回购交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年1 0月10日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日 | |
|--------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------------|------------------------|
| | 债券回购 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 | 67,700,0 00.00 | 100.00% | 291,600 ,000.00 | 100.00% |

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（转型后首日） 2018年01月01日至2018年10月10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 | 424.52 | 100.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 294,262.13 | 100.00% | 1,597.33 | 100.00% |

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年10月10日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,791.73 | 1,956,848.18 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,227.21 | 3,804.22 |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2018年01月01日至2018年10月10日 | 2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,264.01 | 652,282.74 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 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10月10日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 合计 | 0.00 |
| 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12月31日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 创金合信直销 | 1.94 |
| 合计 | 1.94 |

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0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018 年10月10日 | | 上年度可比期间 2017年01月01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 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 712,549. 75 | 3,450.82 | 196,937. 61 | 110,968.73 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2018年10月10日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------|--------|--------|------------|------------|----|
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大事项停牌 | 10.64 | - | - | 66,201 | 991,800.00 | 704,378.64 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2018年10月10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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年10月10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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1) 公允价值****(a) 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**(i) 各层次金融工具公允价值**

于2018年10月10日(基金合同失效前日)，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二层次的余额为301,200.00元，属于第三层次的余额为704,378.64元，无属于第一层次的余额(2017年12月31日：第一层次1,296,572.50元，第二层次1,757,872.20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

上述第三层次资产变动如下：本期交易性金融资产权益工具投资转入第三层级的金额为704,378.64元，截止2018年10月10日(基金合同失效前日)剩余金额为704,378.64元。2018年10月10日(基金合同失效前日)仍持有的资产计入2018年1月1日至2018年10月10日(基金合同失效前日)止期间损益的未实现利得或损失的变动--公允价值变动损益的金额为-209,331.36元。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司净资产预期及市净率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的净资产预期及市净率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年10月10日(基金合同失效前日)，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(转型后)

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 | 4,798,016.07 | 71.16 |
| | 其中：股票 | 4,798,016.07 | 71.16 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 306,244.80 | 4.54 |
| | 其中：债券 | 306,244.80 | 4.54 |
| | 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 | 1,621,990.12 | 24.06 |
| 8 | 其他各项资产 | 16,447.28 | 0.24 |
| 9 | 合计 | 6,742,698.27 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 203,237.07 | 3.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 369,050.00 | 5.84 |
| J | 金融业 | 3,165,831.00 | 50.08 |
| K | 房地产业 | 1,059,898.00 | 16.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,798,016.07 | 75.90 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 名称 | 数量 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 9,300 | 521,730.00 | 8.25 |
| 2 | 000002 | 万科A | 21,900 | 521,658.00 | 8.25 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 18,500 | 466,200.00 | 7.37 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 30,500 | 369,050.00 | 5.84 |
| 5 | 600340 | 华夏幸福 | 14,200 | 361,390.00 | 5.72 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 36,900 | 346,122.00 | 5.48 |
| 7 | 601688 | 华泰证券 | 21,300 | 345,060.00 | 5.46 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 19,800 | 316,998.00 | 5.01 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 59,900 | 316,871.00 | 5.01 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 86,900 | 312,840.00 | 4.95 |

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

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 1,260,115.00 | 19.93 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 919,426.00 | 14.54 |
| 3 | 601336 | 新华保险 | 902,381.00 | 14.27 |
| 4 | 000002 | 万科A | 838,949.00 | 13.27 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 776,023.00 | 12.28 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 736,655.00 | 11.65 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 669,134.00 | 10.59 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 615,134.00 | 9.73 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 594,309.00 | 9.40 |
| 10 | 601155 | 新城控股 | 553,791.00 | 8.76 |
| 11 | 600340 | 华夏幸福 | 538,462.00 | 8.52 |
| 12 | 601229 | 上海银行 | 521,900.00 | 8.26 |
| 13 | 002142 | 宁波银行 | 519,057.00 | 8.21 |
| 14 | 000776 | 广发证券 | 412,496.00 | 6.53 |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 384,258.00 | 6.08 |
| 16 | 000961 | 中南建设 | 383,867.00 | 6.07 |
| 17 | 300750 | 宁德时代 | 342,925.00 | 5.42 |
| 18 | 601128 | 常熟银行 | 323,800.00 | 5.12 |
| 19 | 601288 | 农业银行 | 311,600.00 | 4.93 |
| 20 | 600837 | 海通证券 | 310,403.00 | 4.91 |
| 21 | 000671 | 阳光城 | 190,164.00 | 3.01 |
| 22 | 600622 | 光大嘉宝 | 185,921.60 | 2.94 |
| 23 | 600643 | 爱建集团 | 184,986.00 | 2.93 |
| 24 | 300073 | 当升科技 | 137,232.00 | 2.17 |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 928,494.00 | 14.69 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 585,987.00 | 9.27 |
| 3 | 601336 | 新华保险 | 584,168.00 | 9.24 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 551,143.00 | 8.72 |
| 5 | 601155 | 新城控股 | 545,162.46 | 8.62 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 516,744.00 | 8.17 |
| 7 | 601229 | 上海银行 | 496,995.00 | 7.86 |
| 8 | 000776 | 广发证券 | 410,388.00 | 6.49 |
| 9 | 000961 | 中南建设 | 362,986.00 | 5.74 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 341,836.00 | 5.41 |
| 11 | 000002 | 万科A | 323,135.00 | 5.11 |
| 12 | 600837 | 海通证券 | 320,739.00 | 5.07 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 252,975.00 | 4.00 |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 219,816.00 | 3.48 |
| 15 | 601128 | 常熟银行 | 200,330.00 | 3.17 |
| 16 | 600340 | 华夏幸福 | 194,356.00 | 3.07 |
| 17 | 600643 | 爱建集团 | 187,200.00 | 2.96 |
| 18 | 600622 | 光大嘉宝 | 186,487.00 | 2.95 |
| 19 | 000671 | 阳光城 | 181,578.00 | 2.87 |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 170,665.00 | 2.70 |
| 21 | 300073 | 当升科技 | 142,925.45 | 2.26 |
| 22 | 601066 | 中信建投 | 141,376.00 | 2.24 |

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 | 12,886,168.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,999,307.91 |

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 | 306,244.80 | 4.84 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 306,244.80 | 4.84 |

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 | 019585 | 18国债03 | 3,060 | 306,244.80 | 4.84 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 | 5,679.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,918.45 |
| 5 | 应收申购款 | 849.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,447.28 |

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 | 316,998.00 | 5.01 | 重大事项停牌 |
|---|--------|------|------------|------|--------|

§ 8 投资组合报告（转型前）

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 | 704,378.64 | 40.74 |
| | 其中：股票 | 704,378.64 | 40.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 301,200.00 | 17.42 |
| | 其中：债券 | 301,200.00 | 17.42 |
| | 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 | 715,707.64 | 41.40 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,674.06 | 0.44 |
| 9 | 合计 | 1,728,960.34 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 704,378.64 | 41.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------|-------|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 704,378.64 | 41.12 |

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 | 名称 | 数量 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 600485 | 信威集团 | 66,201 | 704,378.64 | 41.12 |

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 | 600036 | 招商银行 | 292,500.00 | 6.37 |

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 | 600036 | 招商银行 | 288,000.00 | 6.27 |

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 | 292,500.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 288,000.00 |

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 | 301,200.00 | 17.58 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 301,200.00 | 17.58 |

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 | 019585 | 18国债03 | 3,000 | 301,200.00 | 17.58 |
|---|--------|--------|-------|------------|-------|

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 | 395.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,278.98 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|----------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,674.06 |

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 | 600485 | 信威集团 | 704,378.64 | 41.12 | 重大事项停牌 |

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---------------|----------|-----------|--------------|--------|------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 创金合信金融地产精选股票A | 217 | 24,350.31 | 4,478,747.84 | 84.76% | 805,270.24 | 15.24% |
| 创金合信金融地产精选 | 96 | 33,731.84 | 2,891,326.02 | 89.29% | 346,930.96 | 10.71% |

| | | | | | | |
|-----|-----|-----------|--------------|--------|--------------|--------|
| 股票C | | | | | | |
| 合计 | 307 | 27,759.85 | 7,370,073.86 | 86.48% | 1,152,201.20 | 13.52% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额 比例 |
|------------------|---------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 创金合信金融地产精选股票A | 9,358.42 | 0.18% |
| | 创金合信金融地产精选股票C | 1,314.50 | 0.04% |
| | 合计 | 10,672.92 | 0.13% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|---------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 创金合信金融地产精选股票A | 0~10 |
| | 创金合信金融地产精选股票C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信金融地产精选股票A | 0 |
| | 创金合信金融地产精选股票C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 | 持有 | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|----|----|--------|-------|
|----|----|--------|-------|

| 级别 | 人户数(户) | 金份额 | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
|------------|--------|----------|------------|--------|------------|---------|
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 创金合信鑫价值混合A | 150 | 8,650.20 | 942,281.67 | 72.62% | 355,248.89 | 27.38% |
| 创金合信鑫价值混合C | 55 | 5,061.23 | - | 0.00% | 278,367.82 | 100.00% |
| 创金合信鑫价值混合 | 205 | 7,687.31 | 942,281.67 | 59.79% | 633,616.71 | 40.21% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 创金合信鑫价值混合A | 7,900.47 | 0.61% |
| | 创金合信鑫价值混合C | 1,300.02 | 0.47% |
| | 合计 | 9,200.49 | 0.58% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|----------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资 | 创金合信鑫价值混 | 0~10 |

| | | |
|------------------|------------|------|
| 和研究部门负责人持有本开放式基金 | 合A | |
| | 创金合信鑫价值混合C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信鑫价值混合A | 0 |
| | 创金合信鑫价值混合C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| | 创金合信金融地产精选股票A | 创金合信金融地产精选股票C |
|------------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日(2018年10月11日)基金份额总额 | 1,297,530.56 | 278,367.82 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 4,336,666.85 | 3,008,467.01 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 460,619.54 | 75,142.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 110,440.21 | 26,564.15 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,284,018.08 | 3,238,256.98 |

注：（1）创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金于2018年10月11日将基金份额转换为创金合信金融地产股票型证券投资基金；并于同日进行基金份额的折算。

（2）用于计算折算比例的基金份额净值四舍五入保留到小数点后第9位，创金合信金融地产股票经折算后的份额数四舍五入保留到小数点后两位，转换及折算结果请查阅基金的相关公告。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| | 创金合信鑫价值混合A | 创金合信鑫价值混合C |
|--|------------|------------|
|--|------------|------------|

| | | |
|----------------------------|----------------|------------|
| 基金合同生效日(2016年08月30日)基金份额总额 | 800,088,076.57 | 20,800.37 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,991,184.03 | 271,637.80 |
| 本报告期基金总申购份额 | 364,670.25 | 286,456.13 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 3,058,323.72 | 279,726.11 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,297,530.56 | 278,367.82 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,并于2018年9月25日表决通过了《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。

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20,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为3年(含转型期)。

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。

转型后

报告期2018年10月11日（转型后首日） - 2018年12月31日

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 | |
| 第一创业证券 | 2 | 20,885,476.51 | 100.00% | 15,146.60 | 100.00% | - |

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

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 |
| 第一创业证券 | 484,919.40 | 100.00% | 100,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

转型前

报告期2018年01月01日 - 2018年10月10日

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 | |
| 第一创业证券 | 2 | 580,500.00 | 100.00% | 424.52 | 100.00% | - |

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。

本基金本报告期内无交易单元变更。

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 |
| 第一创业证券 | 2,111 | 100.00% | 67,70 | 100.00% | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--|--------------|--|---------------|--|--|--|--|--|
| | , 666. 34 | | 0, 000 .00 | | | | | |
|--|--------------|--|---------------|--|--|--|--|--|

§ 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 | 20180101 - 20180507 | 1, 942 , 281. 67 | 0.00 | 1, 942 , 281. 67 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20180101 - 20181107 | 1, 942 , 281. 67 | 80, 20 3.26 | 1, 150 , 000. 00 | 872, 484.93 | 10.24% |
| | 3 | 20181108 - 20181231 | 0.00 | 5, 781 , 931. 55 | 0.00 | 5, 781, 931. 55 | 67.84% |
| 个人 | 1 | 20181107 | 0.00 | 620, 4 96.05 | 0.00 | 620, 496.05 | 7.28% |

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

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

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

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

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

本基金管理人将建立完善的风险管理机制, 以有效防止上述风险, 最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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。

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年三月二十九日