

# 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 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

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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	创金沪港深精选混合
基金主代码	001662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月24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	389,590,510.82份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取灵活的资产配置体系，通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类别资产的风险收益特征水平进行综合分析，并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标，灵活动态地调整固定收益类资产和权益类资产的比例，以规避或控制市场系统性风险，从而实现长期稳健增长的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 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

## 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

## §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	2016年
本期已实现收益	-57,061,656.35	92,335,586.92	1,668,038.33
本期利润	-96,460,986.36	-168,275.42	11,168,899.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1981	-0.0002	0.0512
本期基金份额净值增长率	-18.26%	2.90%	7.54%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0998	0.1012	0.0335
期末基金资产净值	350,692,977.78	754,701,843.59	249,425,352.25
期末基金份额净值	0.900	1.101	1.070

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

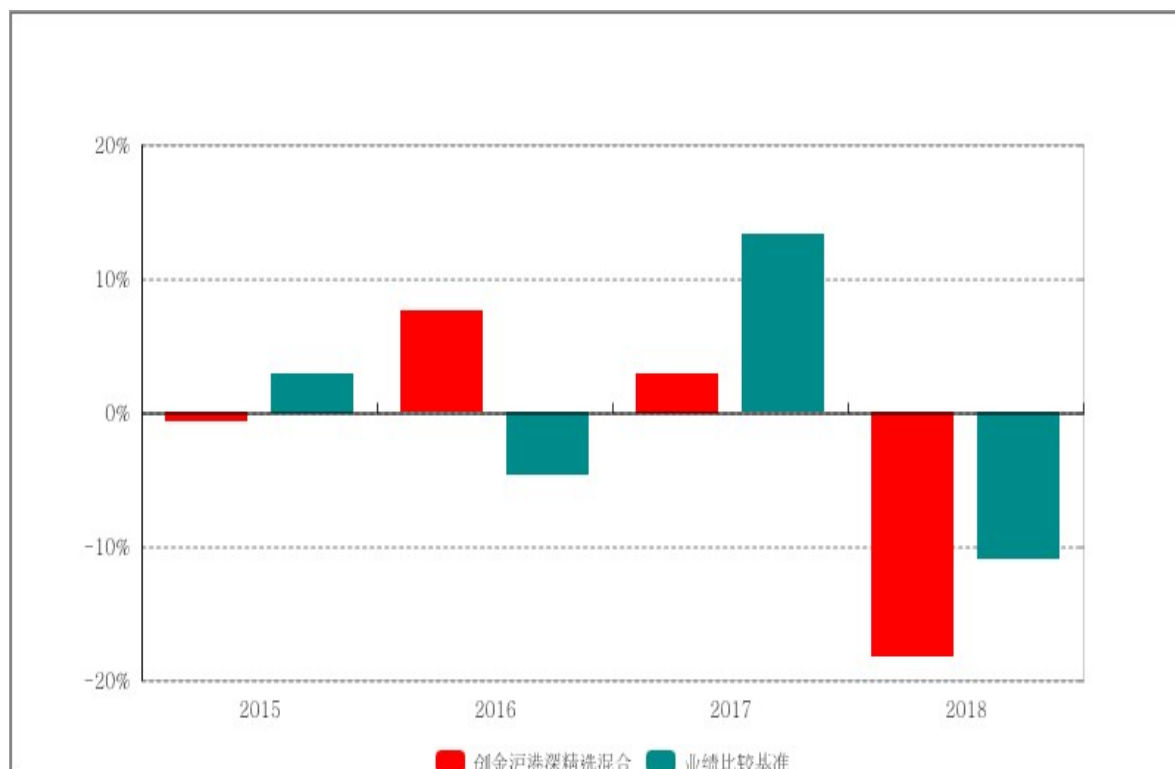
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.36%	1.07%	-5.25%	0.91%	-0.11%	0.16%
过去六个月	-3.54%	0.90%	-6.60%	0.81%	3.06%	0.09%
过去一年	-18.26%	0.88%	-10.94%	0.74%	-7.32%	0.14%
过去三年	-9.55%	1.07%	-3.80%	0.63%	-5.75%	0.44%
自基金合同生效起至今	-10.00%	1.01%	-1.02%	0.70%	-8.98%	0.31%

#### 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

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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		
陈玉辉	本基金基金经理、投资一部总监	2015-08-24	-	15年	陈玉辉先生，中国国籍，经济学硕士，2003年6月加入新疆证券有限责任公司，从事石化行业研究；2005年度获中央电视台、中国证券报联合评选的首届“全国十佳证券分析师”。2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所，任化工行业研究员。2008

					年3月加入招商基金管理有限公司，历任研究部副总监、总监，并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年7月任创金合信基金管理有限公司投资一部总监、基金经理。
胡尧盛	本基金基金经理	2017-12-12	-	5年	胡尧盛先生，中国国籍，江西财经大学金融学硕士，2013年7月加入国元咨询服务（深圳）有限公司，任研究部研究员，负责港股市场消费品行业研究分析工作。2015年6月加入创金合信基金管理有限公司任研究部研究员，现任基金经理。

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

2、证券从业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合规守信情况的说明

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

2018年市场呈现普跌走势，上证50、沪深300、中证2000、创业板指等代表性大中小市值风格年度跌幅均达到20%以上，中小板指数跌幅达到38%。如上一年度策略所述，2018年保持了相对防御的仓位和配置策略，基金组合全年维持了低市净率、低市值、国企股风格配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金沪港深精选混合基金份额净值为0.900元，本报告期内，基金份额净值增长率为-18.26%，同期业绩比较基准收益率为-10.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为三年去杠杆任务的第一年，股票市场2018年提前反映了各领域信用扩张透支和未来的信用内、外生紧缩在实体领域的预期。随着未来两年去杠杆金融政策的深化，实体各领域将陆续确认周期性波动的影响。在以房地产为首的各类资产价格跟随股票市场出现显著下跌前，信用周期仍将处于收缩初始阶段，在此之前应当警惕未来可能出现的资产价格连锁反应，等待信用周期性波动预期兑现和其它资产领域靴子陆续落地。

在国内三年去杠杆宏观政策和国际美元加息缩表、贸易环境恶化影响下，市场出现整体性机会的概率较小，可能阶段性出现局部板块、主题性活跃行情。未来投资中仍然坚持底线思维，将风险和回撤控制放在重要位置，预防市场趋势陷阱、估值陷阱和流动性陷阱。以相对低仓位控制系统性风险和预留逢低买入的仓位机会，组合策略上采取大/小市值、高/低贝塔结合的哑铃型策略，个股方面坚持“三低”选股策略，采取逢低买入向下风险小、低估值、低涨幅个股的类看涨期权补仓策略，重点关注国家关于国企尽快降杠杆政策导向下国企改革个性化基本面反转机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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

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

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2017年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	41,537,981.21	63,780,123.46
结算备付金	8,872,727.39	21,551,902.31
存出保证金	51,475.78	194,920.56
交易性金融资产	201,046,115.65	491,614,907.28
其中：股票投资	201,046,115.65	491,614,907.28
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	190,000,000.00
应收证券清算款	100,157,678.94	267,330.33
应收利息	-8,772.94	-60,990.96
应收股利	-	-
应收申购款	32,979.25	167,708.66
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	351,690,185.28	767,515,901.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> 2018年12月31日	<b>上年度末</b> 2017年12月31日
<b>负 债:</b>		
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	0.44	9,656,898.55
应付赎回款	223,152.13	1,544,214.57
应付管理人报酬	460,481.76	982,141.71
应付托管费	76,747.00	163,690.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	56,145.19	301,656.99
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,680.98	165,455.91
负债合计	997,207.50	12,814,058.05
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	389,590,510.82	685,332,384.73
未分配利润	-38,897,533.04	69,369,458.86
所有者权益合计	350,692,977.78	754,701,843.59
负债和所有者权益总计	351,690,185.28	767,515,901.64

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.900元，基金份额总额389,590,510.82份。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信沪港深研究精选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	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
<b>一、收入</b>	-86,727,855.44	19,306,009.21
1. 利息收入	5,053,436.18	9,740,476.23
其中：存款利息收入	633,523.43	973,252.07
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,419,912.75	8,767,224.16
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-52,859,617.08	98,042,735.10
其中：股票投资收益	-55,510,559.44	91,546,598.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	2,650,942.36	6,496,136.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-39,399,330.01	-92,503,862.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	477,655.47	4,026,660.22
<b>减：二、费用</b>	9,733,130.92	19,474,284.63
1. 管理人报酬	7,348,993.65	14,361,605.35

2. 托管费	1, 224, 832. 32	2, 393, 600. 93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	978, 903. 95	2, 558, 770. 35
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	180, 401. 00	160, 308. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-96, 460, 986. 36	-168, 275. 42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-96, 460, 986. 36	-168, 275. 42

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信沪港深研究精选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)	685, 332, 384. 7 3	69, 369, 458. 86	754, 701, 843. 59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-96, 460, 986. 3 6	-96, 460, 986. 36
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）	-295, 741, 873. 91	-11, 806, 005. 5 4	-307, 547, 879. 45
其中：1. 基金申购款	65, 605, 332. 87	2, 452, 540. 71	68, 057, 873. 58
2. 基金赎回款	-361, 347, 206. 78	-14, 258, 546. 2 5	-375, 605, 753. 03
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）	389,590,510.8 2	-38,897,533.0 4	350,692,977.78
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）	233,089,922.5 9	16,335,429.66	249,425,352.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-168,275.42	-168,275.42
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）	452,242,462.1 4	53,202,304.62	505,444,766.76
其中：1. 基金申购款	1,592,853,164 .24	202,890,247.5 4	1,795,743,411.78
2. 基金赎回款	-1,140,610,70 2.10	-149,687,942. 92	-1,290,298,645.0 2
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）	685,332,384.7 3	69,369,458.86	754,701,843.59

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

创金合信沪港深研究精选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]第1477号《关于准予创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选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303,724,280.18元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第987号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为303,868,723.06份基金份额,其中认购资金利息折合144,442.88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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、股指期货、债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 40%+恒生指数收益率 $\times$ 20%+中债总指数(全价)收益率 $\times$ 40%。

#### 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》、《创金合信沪港深研究精选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。

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 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

#### 7.4.8 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

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。

##### 7.4.8.1.2 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 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。

#### 7.4.8.2 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201 8年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,348,993.65	14,361,605.35
其中：支付销售机构的客户维护费	4,427,637.11	8,728,153.08

注：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、公休假等，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 2018年01月01日至2018 年12月31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托管费	1,224,832.32	2,393,600.93

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前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。

#### 7.4.8.3 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

份额单位:份

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01月01 日至2017年12 月31日
基金合同生效日(2015年08月24日)持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
报告期初持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	10,010,250.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	10,010,250.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.46%

##### 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 12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年1 2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	41,537,981 .21	409,022.5 3	63,780,123. 46	627,598.75

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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

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	50,1 45.8 0	50,1 45.8 0	-

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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200,995,969.85元，属于第二层次的余额为50,145.80元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次461,927,917.93元，第二层次29,686,989.35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	201,046,115.65	57.17
	其中：股票	201,046,115.65	57.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	50,410,708.60	14.33
8	其他各项资产	100,233,361.03	28.50
9	合计	351,690,185.28	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为1,992,829.28元，占净值比为0.57%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-



C	制造业	85,256,086.33	24.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,663,237.09	6.75
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,336,730.65	5.23
G	交通运输、仓储和邮政业	24,245,021.12	6.91
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	29,421,988.50	8.39
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	18,130,222.68	5.17
S	综合	-	-
	合计	199,053,286.37	56.76

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	724,266.92	0.21
金融	1,063,181.08	0.30
工业	205,381.28	0.06
合计	1,992,829.28	0.57

### 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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例 (%)
1	600731	湖南海利	6,040,526	25,491,019.72	7.27
2	600509	天富能源	5,876,537	20,979,237.09	5.98
3	600757	长江传媒	2,780,709	18,130,222.68	5.17
4	601333	广深铁路	4,487,032	14,179,021.12	4.04
5	600089	特变电工	1,968,802	13,368,165.58	3.81
6	600192	长城电工	2,393,742	10,125,528.66	2.89
7	600125	铁龙物流	1,438,000	10,066,000.00	2.87
8	000698	沈阳化工	2,333,739	8,494,809.96	2.42
9	600883	博闻科技	1,367,456	8,300,457.92	2.37
10	000731	四川美丰	1,588,259	7,973,060.18	2.27

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](http://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	601166	兴业银行	30,989,492.50	4.11
2	600089	特变电工	24,160,217.26	3.20
3	000778	新兴铸管	23,699,825.35	3.14
4	600000	浦发银行	22,658,308.18	3.00
5	600757	长江传媒	18,352,143.30	2.43

6	000001	平安银行	16,770,896.00	2.22
7	600125	铁龙物流	15,493,354.29	2.05
8	601939	建设银行	10,760,694.00	1.43
9	000521	长虹美菱	10,549,326.99	1.40
10	601333	广深铁路	9,178,879.00	1.22
11	600861	北京城乡	8,587,922.64	1.14
12	600859	王府井	8,509,159.03	1.13
13	601818	光大银行	8,440,500.00	1.12
14	601169	北京银行	7,366,543.00	0.98
15	601288	农业银行	7,260,000.00	0.96
16	601328	交通银行	7,008,000.00	0.93
17	000069	华侨城 A	6,112,000.00	0.81
18	600837	海通证券	4,665,000.00	0.62
19	600015	华夏银行	3,749,635.00	0.50
20	600642	申能股份	3,542,200.00	0.47

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	601169	北京银行	44,976,023.17	5.96
2	601818	光大银行	44,461,153.13	5.89
3	601998	中信银行	38,899,378.36	5.15
4	600015	华夏银行	38,523,330.46	5.10
5	000876	新希望	27,796,483.60	3.68
6	600089	特变电工	26,780,843.91	3.55
7	601166	兴业银行	23,329,194.28	3.09
8	600784	鲁银投资	21,472,420.21	2.85
9	000778	新兴铸管	20,845,982.00	2.76
10	600000	浦发银行	18,406,086.52	2.44

11	600328	兰太实业	14,272,701.88	1.89
12	600796	钱江生化	13,147,874.00	1.74
13	600192	长城电工	12,786,736.00	1.69
14	600378	天科股份	12,695,365.03	1.68
15	000731	四川美丰	12,659,824.00	1.68
16	000001	平安银行	12,447,956.77	1.65
17	600509	天富能源	9,871,501.30	1.31
18	600731	湖南海利	8,759,902.00	1.16
19	600858	银座股份	7,588,118.31	1.01
20	601333	广深铁路	7,308,767.00	0.97

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	266,175,900.15
卖出股票收入（成交）总额	461,834,802.33

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 四川美丰化工股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年12月1日公告收到子公司四川美丰化工科技有限责任公司（以下简称“美丰科技”）转来绵阳市环境保护局的《行政处罚决定书》，因违反环保法律规定被处共计20万元罚款的行政处罚。美丰科技已按照绵阳市环保局要求完成整改，并通过绵阳市环保局复查，生产经营正常。

本基金投研人员分析认为，该事件发生后该公司经营状况正常，作为央企中国石化下属专业化工子公司，环保处罚和整改属于化工企业日常经营易发问题，此次事件处罚和整改对公司经营和业绩影响无显著直接影响。该公司作为化肥和车用环保特种尿素行业龙头之一，目前估值处于历史相对底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对四川美丰进行了投资。

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	51,475.78
2	应收证券清算款	100,157,678.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-8,772.94
5	应收申购款	32,979.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,233,361.03

**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**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

**§ 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
20,265	19,224.80	298,265.93	0.08%	389,292,244.89	99.92%

**9.2 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	1,197,480.75	0.31%

**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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2015年08月24日)基金份额总额	303,868,723.06
本报告期期初基金份额总额	685,332,384.73
本报告期基金总申购份额	65,605,332.87
减：本报告期基金总赎回份额	361,347,206.78

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	389,590,510.82

## § 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80,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为4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	

金元证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	3	21,926,042.18	3.03%	9,456.81	2.09%	-
平安证券	3	40,831,293.37	5.64%	29,588.63	6.54%	-
广州证券	3	79,288,852.67	10.95%	33,869.57	7.48%	-
国泰君安证券	3	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	3	99,201.42	0.01%	72.55	0.02%	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	3	53,662,399.81	7.41%	17,719.15	3.91%	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	7,533,502.14	1.04%	3,238.69	0.72%	-
西藏东方财富证券	3	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	21,635,547.46	2.99%	15,463.48	3.42%	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	8,147,215.29	1.12%	5,863.65	1.30%	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	3	19,748,727.00	2.73%	8,582.91	1.90%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	3	38,355,522.85	5.30%	16,431.88	3.63%	-



天风证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	4	3,209,903.73	0.44%	1,371.04	0.30%	-
中信证券	6	22,929,823.89	3.17%	16,739.42	3.70%	-
银河证券	6	267,380,078.85	36.91%	194,383.87	42.94%	-
安信证券	6	5,270,747.96	0.73%	2,273.07	0.50%	-
太平洋证券	6	134,299,765.25	18.54%	97,585.06	21.56%	-

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
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	975,000.00	3.22%	-	-	-	-
平安证券	-	-	870,000.00	2.88%	-	-	-	-
广州证券	-	-	2,800,000.00	9.26%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	820,000.00	2.71%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	3,245,000.00	10.73%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	840,000.00	2.78%	-	-	-	-

西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	2,605,000.00	8.61%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	560,000.00	1.85%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	2,540,000.00	8.40%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	1,895,000.00	6.26%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	720,000.00	2.38%	-	-	-	-
中信证券	-	-	370,000.00	1.22%	-	-	-	-
银河证券	-	-	3,450,000.00	11.40%	-	-	-	-

安信证券	-	-	360,000,000.00	1.19%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	8,200,000.00	27.11%	-	-	-	-

## § 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

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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