

# 创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

## 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:招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。

基金托管人招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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99
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	100
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	100
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	100
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	100
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	100

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	101
8.12 投资组合报告附注 .....	101
§9 基金份额持有人信息 .....	102
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	102
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	102
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 .....	102
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	103
§10 开放式基金份额变动 .....	103
§11 重大事件揭示 .....	104
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	104
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.....	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
11.4 基金投资策略的改变 .....	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	104
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.....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	104
11.8 其他重大事件 .....	106
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	110
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.....	110
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	111
§13 备查文件目录 .....	111
13.1 备查文件目录 .....	111
13.2 存放地点 .....	111
13.3 查阅方式.....	111

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证500增强	
基金主代码	002311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月31日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	353,180,254.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证500增强 A	创金合信中证500增强 C
下属分级基金的交易代码	002311	002316
报告期末下属分级基金的份额总额	213,799,076.87份	139,381,177.58份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95555
传真		0755-25832571	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518000	518040
法定代表人		刘学民	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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日起常批报社由《证券日报》变更为《中国证券报》。

### 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	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业

	(特殊普通合伙)	广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路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	
	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C
本期已实现收益	-52,829,204.32	-33,183,995.84	16,570,999.88	2,912,953.32	-443,392.77	-247,670.83
本期利润	-58,746,704.30	-35,450,221.74	18,534,513.80	1,852,451.34	-2,090,291.02	-377,087.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2698	-0.3350	0.1046	0.0886	-0.2267	-0.0715
本期加权平均净值利润率	-28.96%	-37.25%	10.72%	8.92%	-25.04%	-8.06%
本期基金份额净值增长率	-25.82%	-25.86%	11.26%	11.88%	-7.27%	-7.32%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	-50,185,596.95	-32,223,374.36	5,643,105.94	346,524.19	-12,791,044.93	-548,327.55
期末可供分配基金份额利润	-0.2347	-0.2312	0.0317	0.0369	-0.0727	-0.0732
期末基金资产	163,613,	107,157,	183,629,	9,733,34	163,079,	6,937,49

产净值	479.92	803.22	225.80	7.52	262.58	8.01
期末基金份额净值	0.7653	0.7688	1.0317	1.0369	0.9273	0.9268
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年末		2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	-23.47%	-23.12%	3.17%	3.69%	-7.27%	-7.32%

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

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.61%	1.67%	-12.50%	1.74%	1.89%	-0.07%
过去六个月	-16.14%	1.45%	-19.12%	1.50%	2.98%	-0.05%
过去一年	-25.82%	1.38%	-31.81%	1.43%	5.99%	-0.05%
过去三年	-23.47%	1.38%	-43.25%	1.43%	19.78%	-0.05%
自基金合同生效起至	-23.47%	1.38%	-44.11%	1.43%	20.64%	-0.05%

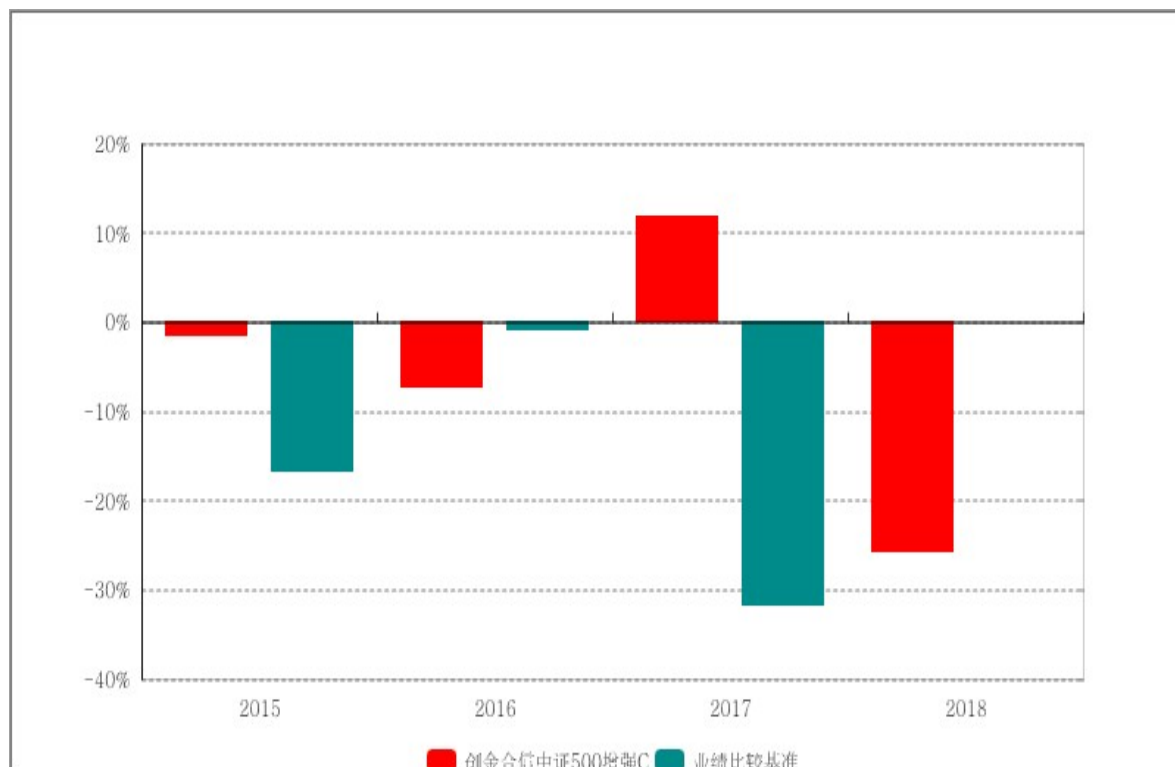
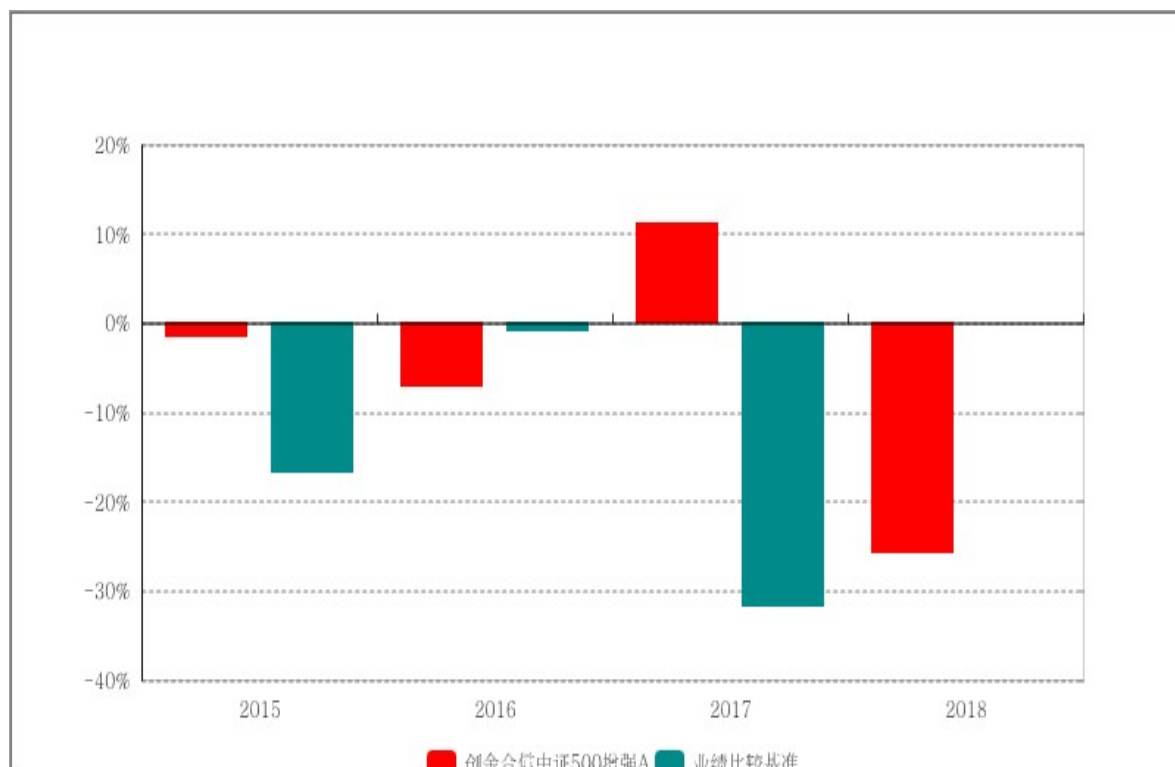


今						
创金合信中证500增强C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三 个月	-10.64%	1.67%	-12.50%	1.74%	1.86%	-0.07%
过去六 个月	-16.24%	1.45%	-19.12%	1.50%	2.88%	-0.05%
过去一 年	-25.86%	1.38%	-31.81%	1.43%	5.95%	-0.05%
过去三 年	-23.12%	1.38%	-43.25%	1.43%	20.13%	-0.05%
自基金 合同生 效起至 今	-23.12%	1.38%	-44.11%	1.43%	20.99%	-0.05%

### 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		
程志田	本基金基金经理、量化投资部总监	2015-12-31	-	12年	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量

					化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。
庞世恩	本基金基金经理	2016-01-08	2018-08-31	7年	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，2016年1月至2018年8月担任本基金基金经理。
秦昌贵	本基金基金经理	2018-12-04	-	13年	秦昌贵先生，中国国籍，华中科技大学金融学硕士。2005年6月加入长江证券股份有限公司，历任衍生产品部高级研究员，资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管。2015年7月加入长江证券（上海）资产管理有限公司，任量化投资部总经理。2017年6月加入创金合信基金管理有限公司，曾任量化投资部副总监、投资经理，现任量化投资部副总监、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

所有投资对象的投资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82次，本基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证500增强A基金份额净值为0.7653元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-25.82%，同期业绩比较基准收益率为-31.81%；截至报告期末创金合信中证500增强C基金份额净值为0.7688元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-25.86%，同期业绩比较基准收益率为-31.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济增长前景趋弱叠加中美贸易摩擦的背景下，出口外需受到一定抑制。2019年的宏观经济不确定性增强，企业利润回落压力加大，经济下行风险仍然存在。从股票市场主要指数的估值水平来看，当前估值均处于历史低位，下行空间有限，2019年或有结构性行情出现。

#### 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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 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24775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	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“创金合信中证500增强基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,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中证500增强基金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>
形成审计意见的基础	<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中证500增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	
其他事项	
其他信息	

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>创金合信中证500增强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”)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中证500增强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中证500增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督创金合信中证500增强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</p>

	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，就可能对导致对创金合信中证500增强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中证500增强基金不能持续经营。（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	2019-03-26

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年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	5,802,655.87	3,486,932.63
结算备付金		4,100,186.70	2,074,116.62
存出保证金		188,562.17	92,251.35
交易性金融资产	7.4.7.2	263,789,908.17	188,433,576.88
其中：股票投资		250,215,542.67	178,395,792.48
基金投资		-	-
债券投资		13,574,365.50	10,037,784.40
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		3,284,158.15	-
应收利息	7.4.7.5	380,976.17	58,925.83
应收股利		-	-
应收申购款		861,716.86	19,229.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		278,408,164.09	194,165,033.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,433,163.95	231.51
应付管理人报酬		184,959.73	129,241.55
应付托管费		23,119.97	16,155.21
应付销售服务费		9,067.94	769.60

应付交易费用	7.4.7.7	815,854.88	516,062.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,714.48	140,000.00
负债合计		7,636,880.95	802,459.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	353,180,254.45	187,372,943.19
未分配利润	7.4.7.10	-82,408,971.31	5,989,630.13
所有者权益合计		270,771,283.14	193,362,573.32
负债和所有者权益总计		278,408,164.09	194,165,033.22

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额353,180,254.45份，其中下属A类基金份额213,799,076.87份，C类基金份额139,381,177.58份。下属A类基金份额净值0.7653元，C类基金份额净值0.7688元。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年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01月01日至2017年12月31日
<b>一、收入</b>		-80,040,830.31	27,151,866.49
1. 利息收入		621,871.60	115,057.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	133,831.22	103,036.56
债券利息收入		488,040.38	8,821.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,199.76

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-72,822,351.77	26,017,138.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-76,471,775.51	24,426,363.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	22,931.21	59,594.16
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	3,626,492.53	1,531,181.04
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-8,183,725.88	903,011.94
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	343,375.74	116,658.42
<b>减：二、费用</b>		14,156,095.73	6,764,901.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	2,383,187.77	1,547,010.45
2. 托管费	7.4.10.2. 2	297,898.51	193,376.29
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	95,090.64	20,650.10
4. 交易费用	7.4.7.18	11,148,706.13	4,823,597.96
5. 利息支出		10,425.80	1,878.11
其中：卖出回购金融资产 支出		10,425.80	1,878.11
6. 税金及附加		0.57	-
7. 其他费用	7.4.7.19	220,786.31	178,388.44
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-94,196,926.04	20,386,965.14

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-94,196,926.04	20,386,965.14

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年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)	187,372,943.19	5,989,630.13	193,362,573.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-94,196,926.04	-94,196,926.04
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）	165,807,311.26	5,798,324.60	171,605,635.86
其中：1. 基金申购款	492,366,826.99	-27,443,786.09	464,923,040.90
2. 基金赎回款	-326,559,515.73	33,242,110.69	-293,317,405.04
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）	353,180,254.45	-82,408,971.31	270,771,283.14
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)	183,356,133.07	-13,339,372.48	170,016,760.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,386,965.14	20,386,965.14
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)	4,016,810.12	-1,057,962.53	2,958,847.59
其中：1. 基金申购款	76,197,293.10	-1,553,884.15	74,643,408.95
2. 基金赎回款	-72,180,482.98	495,921.62	-71,684,561.36
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)	187,372,943.19	5,989,630.13	193,362,573.32

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

创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]3049号《关于准予创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。

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

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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

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

##### 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外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。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。

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)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收益分配基准日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；(2)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该类别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；(3) 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；

(4) 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；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，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。

### 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	5,802,655.87	3,486,932.63
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	5,802,655.87	3,486,932.63

##### 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	259,256,524.81	250,215,542.67	-9,040,982.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	13,590,412.00	13,574,365.50	-16,046.50
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,590,412.00	13,574,365.50	-16,046.50
资产支持证券	-	-	-	



基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		272,846,936.81	263,789,908.17	-9,057,028.64
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		179,249,624.64	178,395,792.48	-853,832.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	10,057,255.00	10,037,784.40	-19,470.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,057,255.00	10,037,784.40	-19,470.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		189,306,879.64	188,433,576.88	-873,302.76

#### 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	1,365.70	1,446.62
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,029.50	1,026.74
应收债券利息	377,487.58	56,406.82
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	93.39	45.65
合计	380,976.17	58,925.83

#### 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	815,854.88	516,062.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	815,854.88	516,062.03

#### 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	20.52	-
预提费用	170,693.96	140,000.00
合计	170,714.48	140,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 创金合信中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	177,986,119.86	177,986,119.86
本期申购	227,657,665.27	227,657,665.27
本期赎回(以“-”号填列)	-191,844,708.26	-191,844,708.26
本期末	213,799,076.87	213,799,076.87

## 7.4.7.9.2 创金合信中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,386,823.33	9,386,823.33
本期申购	264,709,161.72	264,709,161.72
本期赎回(以“-”号填列)	-134,714,807.47	-134,714,807.47
本期末	139,381,177.58	139,381,177.58

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

## 7.4.7.10.1 创金合信中证500增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,329,443.22	-1,686,337.28	5,643,105.94
本期利润	-52,829,204.32	-5,917,499.98	-58,746,704.30
本期基金份额交易产生的变动数	2,634,933.52	283,067.89	2,918,001.41
其中：基金申购款	-6,720,863.21	-6,097,391.30	-12,818,254.51
基金赎回款	9,355,796.73	6,380,459.19	15,736,255.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,864,827.58	-7,320,769.37	-50,185,596.95

## 7.4.7.10.2 创金合信中证500增强C

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	434,795.22	-88,271.03	346,524.19
本期利润	-33,183,995.84	-2,266,225.90	-35,450,221.74
本期基金份额交易产生的变动数	5,305,965.70	-2,425,642.51	2,880,323.19
其中：基金申购款	-7,278,159.23	-7,347,372.35	-14,625,531.58
基金赎回款	12,584,124.93	4,921,729.84	17,505,854.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,443,234.92	-4,780,139.44	-32,223,374.36

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
活期存款利息收入	48,814.36	70,046.09
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	82,406.88	31,596.14
其他	2,609.98	1,394.33
合计	133,831.22	103,036.56

## 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01月01日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	6,044,068,266.92	2,491,213,475.14

减：卖出股票成本总额	6,120,540,042.43	2,466,787,111.76
买卖股票差价收入	-76,471,775.51	24,426,363.38

#### 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
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付 ) 差价收入	22,931.21	59,594.16
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	22,931.21	59,594.16

##### 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01月01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	23,203,686.82	386,941.45
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	22,530,123.00	327,300.00
减：应收利息总额	650,632.61	47.29
买卖债券差价收入	22,931.21	59,594.16

#### 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01月01日至2017年 12月31日
股票投资产生的股利收益	3,626,492.53	1,531,181.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,626,492.53	1,531,181.04

#### 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
1. 交易性金融资产	-8,183,725.88	903,011.94
——股票投资	-8,187,149.98	922,482.54
——债券投资	3,424.10	-19,470.60
——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	-8,183,725.88	903,011.94

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
基金赎回费收入	340,983.26	116,542.08
基金转换费收入	2,392.48	116.34
合计	343,375.74	116,658.42

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	11,148,706.13	4,823,597.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,148,706.13	4,823,597.96

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
审计费用	60,000.00	30,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
汇划手续费	13,122.53	8,388.44
指数使用费	47,663.78	40,000.00
合计	220,786.31	178,388.44

#### 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

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司(“第一创业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

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

金额单位：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12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	4,899,658,945.08	40.03%	2,980,649,538.39	60.00%

##### 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 债券交易

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	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	12,091,364.93	38.66%	10,002,196.45	100.00%

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	1,500,000.00	1.61%	19,600,000.00	100.00%

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年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	1,569,780.21	39.07%	-	-

有限公司				
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	955,926.23	50.54%	410,570.62	79.56%

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。

#### 7.4.10.2 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	2,383,187.77	1,547,010.45
其中: 支付销售机构的客户维护费	272,950.67	27,725.83

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 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12月31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	297, 898. 51	193, 376. 29

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
招商银行	0.00	2, 616. 59	2, 616. 59
创金合信直销	0.00	65, 163. 57	65, 163. 57
第一创业	0.00	17. 16	17. 16
合计	0.00	67, 797. 32	67, 797. 32
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		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
招商银行	0.00	88. 12	88. 12
创金合信直销	0.00	16, 175. 81	16, 175. 81

第一创业	0.00	0.27	0.27
合计	0.00	16,264.20	16,264.20

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 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

创金合信中证500增强A

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12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.34%	2.81%

创金合信中证500增强C

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12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.59%	53.27%

**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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2018年01月01日至2018年12月31日		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
招商银行 股份有限 公司	5,802,655.87	48,814.36	3,486,932.63	70,046.09

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 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	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项停牌	7.97	2019-01-10	8.77	76,100	601,607.00	606,517.00	-
600270	外运发展	2018-12-13	重大事项停牌	20.99	-	-	6,600	141,722.43	138,534.00	-
002183	怡亚通	2018-12-25	重大事项停牌	5.01	2019-01-02	4.96	21,200	112,033.75	106,212.00	-

注：根据《中外运空运发展股份有限公司关于公司股票终止上市的公告》，外运发展（股票代码：600270）于2018年12月28日终止上市。

#### 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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（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	-	9,607,851.00
合计	-	9,607,851.00

#### 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	-	429,933.40
AAA以下	14,965.50	0.00
未评级	13,559,400.00	0.00
合计	13,574,365.50	429,933.40

#### 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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设



计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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%。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0.33%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为273,214,517.83元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 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	5,802,655.87	-	-	-	5,802,655.87
结算备付金	4,100,186.70	-	-	-	4,100,186.70
存出保证金	188,562.17	-	-	-	188,562.17
交易性金融资产	13,559,400.00	-	14,965.50	250,215,542.67	263,789,908.17
应收证券清算	-	-	-	3,284,158.15	3,284,158.15

款					
应收利息	-	-	-	380,976.17	380,976.17
应收申购款	-	-	-	861,716.86	861,716.86
资产总计	23,650,804.74	-	14,965.50	254,742,393.85	278,408,164.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,433,163.95	6,433,163.95
应付管理人报酬	-	-	-	184,959.73	184,959.73
应付托管费	-	-	-	23,119.97	23,119.97
应付销售服务费	-	-	-	9,067.94	9,067.94
应付交易费用	-	-	-	815,854.88	815,854.88
其他负债	-	-	-	170,714.48	170,714.48
负债总计	-	-	-	7,636,880.95	7,636,880.95
利率敏感度缺口	23,650,804.74	-	14,965.50	247,105,512.90	270,771,283.14
上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,486,932.63	-	-	-	3,486,932.63
结算备付金	2,074,116.62	-	-	-	2,074,116.62
存出保证金	92,251.35	-	-	-	92,251.35
交易性	9,607,851.00	429,933.40	-	178,395,792.48	188,433,576.88

金融资产					
应收利息	-	-	-	58,925.83	58,925.83
应收申购款	-	-	-	19,229.91	19,229.91
资产总计	15,261,151.60	429,933.40	-	178,473,948.22	194,165,033.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	231.51	231.51
应付管理人报酬	-	-	-	129,241.55	129,241.55
应付托管费	-	-	-	16,155.21	16,155.21
应付销售服务费	-	-	-	769.60	769.60
应付交易费用	-	-	-	516,062.03	516,062.03
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	802,459.90	802,459.90
利率敏感度缺口	15,261,151.60	429,933.40	-	177,671,488.32	193,362,573.32

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.01%(2017年12月31日：5.19%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

#### 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	250,215,542.67	92.41	178,395,792.48	92.26
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	250,215,542.67	92.41	178,395,792.48	92.26

## 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	12,457,573.17	8,364,005.10
	比较基准下降5%资产净值变动	-12,457,573.17	-8,364,005.10

## 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249,329,099.37元，属于第二层次的余额为14,460,808.80元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次169,940,205.82元，第二层次18,493,371.06元，无第三层次)。

## (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	250,215,542.67	89.87
	其中：股票	250,215,542.67	89.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,574,365.50	4.88
	其中：债券	13,574,365.50	4.88
	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	9,902,842.57	3.56
8	其他各项资产	4,715,413.35	1.69
9	合计	278,408,164.09	100.00

### 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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,167,230.00	0.80
B	采矿业	7,078,393.38	2.61
C	制造业	117,703,978.37	43.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,587,440.00	2.43
E	建筑业	4,082,747.00	1.51
F	批发和零售业	11,366,261.68	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	7,585,301.00	2.80
H	住宿和餐饮业	796,404.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,985,988.52	7.38
J	金融业	4,140,438.00	1.53
K	房地产业	11,713,203.05	4.33
L	租赁和商务服务业	2,893,669.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	266,955.15	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	722,475.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	6,480,662.69	2.39
S	综合	2,468,004.00	0.91
	合计	206,039,150.84	76.09

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	225,854.00	0.08



B	采矿业	1,134,895.84	0.42
C	制造业	22,505,292.06	8.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,499,186.12	0.92
E	建筑业	655,923.00	0.24
F	批发和零售业	3,498,545.93	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,824,633.00	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,436,087.00	0.53
J	金融业	3,119,835.40	1.15
K	房地产业	3,163,962.00	1.17
L	租赁和商务服务业	646,359.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,002,634.48	0.74
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	1,218,583.00	0.45
S	综合	244,601.00	0.09
	合计	44,176,391.83	16.32

### 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600201	生物股份	127,279	2,112,831.40	0.78
2	300146	汤臣倍健	100,600	1,709,194.00	0.63

3	600256	广汇能源	453,500	1,705,160.00	0.63
4	600426	华鲁恒升	134,400	1,622,208.00	0.60
5	000623	吉林敖东	111,800	1,613,274.00	0.60
6	600642	申能股份	329,000	1,605,520.00	0.59
7	600820	隧道股份	242,000	1,514,920.00	0.56
8	600879	航天电子	271,900	1,470,979.00	0.54
9	300383	光环新网	114,200	1,446,914.00	0.53
10	002195	二三四五	390,000	1,439,100.00	0.53
11	601168	西部矿业	245,200	1,427,064.00	0.53
12	600881	亚泰集团	422,100	1,397,151.00	0.52
13	000581	威孚高科	77,000	1,359,820.00	0.50
14	000997	新大陆	92,000	1,346,880.00	0.50
15	000060	中金岭南	336,100	1,330,956.00	0.49
16	600567	山鹰纸业	426,200	1,329,744.00	0.49
17	600143	金发科技	266,400	1,318,680.00	0.49
18	000039	中集集团	121,900	1,289,702.00	0.48
19	600875	东方电气	162,600	1,282,914.00	0.47
20	600160	巨化股份	191,842	1,271,912.46	0.47
21	002013	中航机电	193,500	1,259,685.00	0.47
22	000686	东北证券	199,500	1,248,870.00	0.46
23	601872	招商轮船	336,000	1,239,840.00	0.46
24	000009	中国宝安	287,400	1,238,694.00	0.46
25	002078	太阳纸业	217,000	1,236,900.00	0.46
26	000778	新兴铸管	285,400	1,230,074.00	0.45
27	000656	金科股份	193,529	1,197,944.51	0.44
28	002299	圣农发展	71,300	1,179,302.00	0.44
29	600872	中炬高新	39,500	1,163,670.00	0.43
30	002373	千方科技	102,600	1,140,912.00	0.42
31	600737	中粮糖业	153,900	1,132,704.00	0.42
32	600266	北京城建	142,400	1,127,808.00	0.42
33	002223	鱼跃医疗	57,400	1,125,614.00	0.42

34	600507	方大特钢	112,400	1,122,876.00	0.41
35	000488	晨鸣纸业	200,100	1,122,561.00	0.41
36	002589	瑞康医药	161,000	1,122,170.00	0.41
37	300088	长信科技	270,400	1,122,160.00	0.41
38	000598	兴蓉环境	274,400	1,105,832.00	0.41
39	603369	今世缘	75,800	1,098,342.00	0.41
40	600649	城投控股	199,700	1,092,359.00	0.40
41	600511	国药股份	46,700	1,085,775.00	0.40
42	600039	四川路桥	330,300	1,083,384.00	0.40
43	601179	中国西电	321,500	1,080,240.00	0.40
44	600500	中化国际	157,400	1,076,616.00	0.40
45	002092	中泰化学	151,500	1,068,075.00	0.39
46	600811	东方集团	291,400	1,066,524.00	0.39
47	002152	广电运通	189,600	1,063,656.00	0.39
48	600060	海信电器	122,200	1,060,696.00	0.39
49	601966	玲珑轮胎	77,386	1,056,318.90	0.39
50	000878	云南铜业	133,000	1,054,690.00	0.39
51	600782	新钢股份	206,700	1,052,103.00	0.39
52	002004	华邦健康	224,300	1,034,023.00	0.38
53	300166	东方国信	99,300	1,028,748.00	0.38
54	002244	滨江集团	257,400	1,024,452.00	0.38
55	000028	国药一致	24,563	1,017,890.72	0.38
56	000685	中山公用	145,000	1,015,000.00	0.37
57	600037	歌华有线	117,008	1,005,098.72	0.37
58	600282	南钢股份	293,800	1,004,796.00	0.37
59	600348	阳泉煤业	198,500	1,000,440.00	0.37
60	000690	宝新能源	148,600	1,000,078.00	0.37
61	600717	天津港	141,400	999,698.00	0.37
62	000970	中科三环	136,200	998,346.00	0.37
63	000596	古井贡酒	18,500	998,260.00	0.37
64	600804	鹏博士	141,900	997,557.00	0.37

65	002410	广联达	47,800	994,718.00	0.37
66	002030	达安基因	97,000	985,520.00	0.36
67	600582	天地科技	286,400	979,488.00	0.36
68	000998	隆平高科	66,000	976,800.00	0.36
69	600823	世茂股份	259,400	975,344.00	0.36
70	300058	蓝色光标	224,300	973,462.00	0.36
71	000960	锡业股份	101,100	964,494.00	0.36
72	601958	金钼股份	162,500	962,000.00	0.36
73	600079	人福医药	94,700	960,258.00	0.35
74	300026	红日药业	312,600	953,430.00	0.35
75	600967	内蒙一机	91,600	952,640.00	0.35
76	600633	浙数文化	116,414	948,774.10	0.35
77	601231	环旭电子	105,100	945,900.00	0.35
78	002317	众生药业	112,300	937,705.00	0.35
79	002127	南极电商	124,500	936,240.00	0.35
80	300027	华谊兄弟	199,400	935,186.00	0.35
81	300010	立思辰	128,600	933,636.00	0.34
82	002444	巨星科技	98,000	929,040.00	0.34
83	600699	均胜电子	39,700	927,392.00	0.34
84	600017	日照港	334,500	923,220.00	0.34
85	601717	郑煤机	166,900	922,957.00	0.34
86	002563	森马服饰	102,000	909,840.00	0.34
87	000848	承德露露	113,100	909,324.00	0.34
88	600161	天坛生物	42,730	908,012.50	0.34
89	002280	联络互动	234,600	907,902.00	0.34
90	601098	中南传媒	72,500	906,250.00	0.33
91	000926	福星股份	146,360	895,723.20	0.33
92	601678	滨化股份	210,820	889,660.40	0.33
93	600557	康缘药业	85,900	883,052.00	0.33
94	600623	华谊集团	109,200	882,336.00	0.33
95	000547	航天发展	116,300	879,228.00	0.32

96	600525	长园集团	199,000	871,620.00	0.32
97	000401	冀东水泥	70,300	870,314.00	0.32
98	000012	南玻 A	218,100	870,219.00	0.32
99	600750	江中药业	51,100	865,123.00	0.32
100	600611	大众交通	216,800	865,032.00	0.32
101	600787	中储股份	172,100	860,500.00	0.32
102	600694	大商股份	35,400	856,326.00	0.32
103	000537	广宇发展	113,766	852,107.34	0.31
104	600260	凯乐科技	50,000	848,500.00	0.31
105	000021	深科技	147,454	847,860.50	0.31
106	300159	新研股份	183,600	846,396.00	0.31
107	601801	皖新传媒	125,600	839,008.00	0.31
108	600765	中航重机	112,000	833,280.00	0.31
109	600580	卧龙电气	132,200	832,860.00	0.31
110	002048	宁波华翔	79,800	832,314.00	0.31
111	603228	景旺电子	16,600	829,834.00	0.31
112	600777	新潮能源	431,500	824,165.00	0.30
113	002583	海能达	104,400	823,716.00	0.30
114	601016	节能风电	352,800	818,496.00	0.30
115	600584	长电科技	99,000	815,760.00	0.30
116	601311	骆驼股份	92,200	814,126.00	0.30
117	600366	宁波韵升	161,600	809,616.00	0.30
118	000501	鄂武商 A	85,400	809,592.00	0.30
119	600565	迪马股份	309,900	805,740.00	0.30
120	600839	四川长虹	345,000	796,950.00	0.29
121	600258	首旅酒店	49,900	796,404.00	0.29
122	603198	迎驾贡酒	56,000	790,160.00	0.29
123	000541	佛山照明	152,400	789,432.00	0.29
124	600657	信达地产	200,300	787,179.00	0.29
125	600594	益佰制药	142,500	786,600.00	0.29
126	000636	风华高科	72,800	781,872.00	0.29

127	000887	中鼎股份	76,800	777,216.00	0.29
128	601718	际华集团	230,300	771,505.00	0.28
129	000078	海王生物	258,300	769,734.00	0.28
130	000758	中色股份	210,200	767,230.00	0.28
131	002340	格林美	198,400	761,856.00	0.28
132	002344	海宁皮城	166,000	755,300.00	0.28
133	600006	东风汽车	206,500	743,400.00	0.27
134	603328	依顿电子	74,700	739,530.00	0.27
135	300182	捷成股份	170,761	732,564.69	0.27
136	603888	新华网	56,640	727,257.60	0.27
137	002640	跨境通	67,100	724,680.00	0.27
138	002385	大北农	226,000	723,200.00	0.27
139	300347	泰格医药	16,900	722,475.00	0.27
140	603556	海兴电力	55,000	715,000.00	0.26
141	000667	美好置业	277,700	694,250.00	0.26
142	600380	健康元	103,900	693,013.00	0.26
143	002500	山西证券	116,900	692,048.00	0.26
144	600808	马钢股份	200,000	692,000.00	0.26
145	601928	凤凰传媒	86,900	689,986.00	0.25
146	002416	爱施德	116,660	685,960.80	0.25
147	600022	山东钢铁	435,400	683,578.00	0.25
148	002470	金正大	107,156	677,225.92	0.25
149	300324	旋极信息	118,900	667,029.00	0.25
150	300315	掌趣科技	187,300	661,169.00	0.24
151	002345	潮宏基	147,300	658,431.00	0.24
152	600307	酒钢宏兴	343,700	656,467.00	0.24
153	300253	卫宁健康	52,200	650,412.00	0.24
154	300291	华录百纳	146,000	649,700.00	0.24
155	600597	光明乳业	75,100	627,836.00	0.23
156	002131	利欧股份	421,900	620,193.00	0.23
157	000999	华润三九	24,800	616,528.00	0.23

158	600499	科达洁能	151,500	612,060.00	0.23
159	300002	神州泰岳	184,200	607,860.00	0.22
160	600572	康恩贝	102,500	607,825.00	0.22
161	000761	本钢板材	180,600	606,816.00	0.22
162	000987	越秀金控	76,100	606,517.00	0.22
163	600179	安通控股	90,700	603,155.00	0.22
164	600376	首开股份	83,200	598,208.00	0.22
165	601005	重庆钢铁	308,200	597,908.00	0.22
166	603025	大豪科技	53,200	593,180.00	0.22
167	600978	宜华生活	143,100	586,710.00	0.22
168	000860	顺鑫农业	18,100	577,209.00	0.21
169	601608	中信重工	221,700	576,420.00	0.21
170	002028	思源电气	58,400	576,408.00	0.21
171	600291	西水股份	55,900	575,211.00	0.21
172	601866	中远海发	252,100	574,788.00	0.21
173	000750	国海证券	127,500	555,900.00	0.21
174	600757	长江传媒	85,200	555,504.00	0.21
175	603000	人民网	75,900	554,070.00	0.20
176	002332	仙琚制药	89,200	546,796.00	0.20
177	300450	先导智能	18,800	544,072.00	0.20
178	600655	豫园股份	73,400	543,160.00	0.20
179	002439	启明星辰	26,100	536,616.00	0.20
180	002049	紫光国微	18,400	531,760.00	0.20
181	601003	柳钢股份	80,300	527,571.00	0.19
182	002815	崇达技术	35,700	521,577.00	0.19
183	002375	亚厦股份	103,000	519,120.00	0.19
184	002465	海格通信	66,500	518,700.00	0.19
185	600021	上海电力	63,900	517,590.00	0.19
186	002463	沪电股份	72,100	516,957.00	0.19
187	600971	恒源煤电	91,726	516,417.38	0.19
188	002129	中环股份	71,000	513,330.00	0.19

189	002390	信邦制药	125,500	513,295.00	0.19
190	600801	华新水泥	30,500	509,960.00	0.19
191	600600	青岛啤酒	14,600	508,956.00	0.19
192	600416	湘电股份	97,900	505,164.00	0.19
193	600298	安琪酵母	19,900	502,077.00	0.19
194	002266	浙富控股	122,900	500,203.00	0.18
195	600743	华远地产	204,200	494,164.00	0.18
196	000089	深圳机场	62,900	489,991.00	0.18
197	002074	国轩高科	41,700	482,052.00	0.18
198	600126	杭钢股份	103,680	467,596.80	0.17
199	002588	史丹利	118,300	460,187.00	0.17
200	603355	莱克电气	20,400	438,600.00	0.16
201	300115	长盈精密	53,200	435,708.00	0.16
202	603806	福斯特	16,000	428,800.00	0.16
203	600373	中文传媒	32,900	428,029.00	0.16
204	000513	丽珠集团	17,000	427,550.00	0.16
205	600673	东阳光科	57,500	418,600.00	0.15
206	600618	氯碱化工	63,790	413,997.10	0.15
207	300413	芒果超媒	11,100	410,811.00	0.15
208	600895	张江高科	27,100	405,145.00	0.15
209	002354	天神娱乐	75,700	396,668.00	0.15
210	600827	百联股份	45,900	387,855.00	0.14
211	002384	东山精密	34,300	387,247.00	0.14
212	600779	水井坊	12,200	386,374.00	0.14
213	000990	诚志股份	32,100	385,521.00	0.14
214	600056	中国医药	30,300	380,871.00	0.14
215	603885	吉祥航空	30,300	379,659.00	0.14
216	600863	内蒙华电	163,200	376,992.00	0.14
217	002273	水晶光电	39,200	374,752.00	0.14
218	002110	三钢闽光	29,300	374,747.00	0.14
219	600325	华发股份	60,100	372,620.00	0.14



220	002268	卫士通	20,600	367,916.00	0.14
221	300168	万达信息	30,500	365,695.00	0.14
222	002038	双鹭药业	14,600	362,226.00	0.13
223	002250	联化科技	38,300	361,169.00	0.13
224	600125	铁龙物流	51,100	357,700.00	0.13
225	000830	鲁西化工	36,400	356,720.00	0.13
226	002051	中工国际	31,700	351,236.00	0.13
227	600183	生益科技	34,600	348,076.00	0.13
228	002281	光迅科技	12,800	343,808.00	0.13
229	002507	涪陵榨菜	15,800	341,280.00	0.13
230	600718	东软集团	28,692	331,392.60	0.12
231	002506	协鑫集成	65,500	327,500.00	0.12
232	600755	厦门国贸	46,700	325,966.00	0.12
233	600885	宏发股份	14,400	324,864.00	0.12
234	600993	马应龙	23,500	315,370.00	0.12
235	600120	浙江东方	24,400	306,464.00	0.11
236	600970	中材国际	55,800	305,226.00	0.11
237	000681	视觉中国	13,000	303,160.00	0.11
238	000718	苏宁环球	95,000	302,100.00	0.11
239	000418	小天鹅 A	6,800	294,100.00	0.11
240	002174	游族网络	15,700	291,863.00	0.11
241	002056	横店东磁	52,400	289,772.00	0.11
242	600859	王府井	21,100	286,116.00	0.11
243	600835	上海机电	19,600	285,180.00	0.11
244	000975	银泰资源	27,700	282,263.00	0.10
245	600478	科力远	72,100	281,190.00	0.10
246	300287	飞利信	73,800	278,964.00	0.10
247	002358	森源电气	15,500	275,900.00	0.10
248	002002	鸿达兴业	94,400	271,872.00	0.10
249	002665	首航节能	96,300	270,603.00	0.10
250	600315	上海家化	9,900	270,270.00	0.10

251	600169	太原重工	120,700	269,161.00	0.10
252	300274	阳光电源	30,000	267,600.00	0.10
253	601689	拓普集团	18,100	267,518.00	0.10
254	002249	大洋电机	80,700	266,310.00	0.10
255	002233	塔牌集团	26,300	264,578.00	0.10
256	002221	东华能源	32,600	262,756.00	0.10
257	600392	盛和资源	30,400	261,744.00	0.10
258	000062	深圳华强	15,426	256,997.16	0.09
259	600195	中牧股份	24,080	256,211.20	0.09
260	603568	伟明环保	11,119	254,069.15	0.09
261	000049	德赛电池	8,800	252,384.00	0.09
262	000829	天音控股	44,100	247,401.00	0.09
263	600759	洲际油气	104,400	246,384.00	0.09
264	002642	荣之联	38,200	246,008.00	0.09
265	002251	步步高	32,200	238,924.00	0.09
266	300001	特锐德	13,200	231,396.00	0.09
267	600643	爱建集团	27,200	230,928.00	0.09
268	000090	天健集团	49,800	229,080.00	0.08
269	600862	中航高科	40,200	225,120.00	0.08
270	600773	西藏城投	37,100	222,600.00	0.08
271	000008	神州高铁	56,500	219,785.00	0.08
272	600184	光电股份	21,900	213,963.00	0.08
273	603077	和邦生物	131,700	213,354.00	0.08
274	000066	中国长城	44,700	211,878.00	0.08
275	600166	福田汽车	112,700	205,114.00	0.08
276	000930	中粮生化	27,400	203,308.00	0.08
277	002399	海普瑞	8,500	195,925.00	0.07
278	000559	万向钱潮	37,600	192,512.00	0.07
279	002176	江特电机	31,600	185,492.00	0.07
280	600959	江苏有线	43,100	177,572.00	0.07
281	000813	德展健康	18,900	173,502.00	0.06

282	000729	燕京啤酒	30,500	172,020.00	0.06
283	600155	华创阳安	22,600	170,178.00	0.06
284	600338	西藏珠峰	8,500	165,155.00	0.06
285	603899	晨光文具	5,257	159,024.25	0.06
286	002372	伟星新材	10,200	158,202.00	0.06
287	600466	蓝光发展	29,200	157,096.00	0.06
288	600270	外运发展	6,600	138,534.00	0.05
289	002019	亿帆医药	12,900	138,030.00	0.05
290	300418	昆仑万维	10,125	130,207.50	0.05
291	600884	杉杉股份	9,600	124,032.00	0.05
292	600138	中青旅	9,500	122,455.00	0.05
293	002353	杰瑞股份	7,800	117,000.00	0.04
294	600388	龙净环保	11,400	115,710.00	0.04
295	601106	中国一重	41,000	109,470.00	0.04
296	000600	建投能源	21,800	109,436.00	0.04
297	002308	威创股份	24,200	107,690.00	0.04
298	002183	怡亚通	21,200	106,212.00	0.04
299	600277	亿利洁能	18,000	101,880.00	0.04
300	002831	裕同科技	2,500	100,150.00	0.04
301	000988	华工科技	8,100	96,714.00	0.04
302	600409	三友化工	16,400	93,808.00	0.03
303	002371	北方华创	2,400	90,624.00	0.03
304	601000	唐山港	36,100	85,918.00	0.03
305	002663	普邦股份	32,300	79,781.00	0.03
306	002191	劲嘉股份	10,119	79,029.39	0.03
307	000738	航发控制	6,100	73,566.00	0.03
308	300113	顺网科技	5,000	63,550.00	0.02
309	600410	华胜天成	10,700	62,702.00	0.02
310	601128	常熟银行	9,900	60,786.00	0.02
311	600536	中国软件	2,800	58,604.00	0.02
312	600064	南京高科	7,300	57,524.00	0.02

313	600729	重庆百货	2,000	56,600.00	0.02
314	600460	士兰微	6,500	52,780.00	0.02
315	300316	晶盛机电	4,900	49,098.00	0.02
316	600575	皖江物流	22,200	47,286.00	0.02
317	000528	柳工	7,500	45,525.00	0.02
318	600435	北方导航	5,000	37,050.00	0.01
319	600848	上海临港	1,700	35,156.00	0.01
320	300133	华策影视	3,400	30,464.00	0.01
321	002407	多氟多	2,700	29,592.00	0.01
322	600312	平高电气	3,300	26,664.00	0.01
323	002408	齐翔腾达	3,600	24,624.00	0.01
324	002603	以岭药业	2,100	21,966.00	0.01
325	600167	联美控股	2,400	21,696.00	0.01
326	002285	世联行	4,100	20,828.00	0.01
327	600026	中远海能	4,500	19,980.00	0.01
328	000027	深圳能源	3,200	16,800.00	0.01
329	600062	华润双鹤	1,295	15,656.55	0.01
330	600418	江淮汽车	3,200	15,392.00	0.01
331	300197	铁汉生态	3,400	12,886.00	0.00
332	600598	北大荒	1,300	11,128.00	0.00
333	002440	闰土股份	1,100	9,900.00	0.00
334	000807	云铝股份	2,100	8,148.00	0.00
335	002491	通鼎互联	800	6,304.00	0.00
336	002155	湖南黄金	800	6,280.00	0.00

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000719	中原传媒	68,300	537,521.00	0.20
2	603288	海天味业	7,700	529,760.00	0.20

3	002475	立讯精密	36,800	517,408.00	0.19
4	600016	民生银行	89,300	511,689.00	0.19
5	603611	诺力股份	41,500	509,620.00	0.19
6	600269	赣粤高速	130,500	508,950.00	0.19
7	600089	特变电工	74,900	508,571.00	0.19
8	601677	明泰铝业	57,800	508,062.00	0.19
9	002339	积成电子	83,000	507,960.00	0.19
10	600739	辽宁成大	48,400	506,264.00	0.19
11	600031	三一重工	60,700	506,238.00	0.19
12	600606	绿地控股	82,700	505,297.00	0.19
13	600585	海螺水泥	17,200	503,616.00	0.19
14	600252	中恒集团	195,700	502,949.00	0.19
15	002541	鸿路钢构	71,300	500,526.00	0.18
16	603979	金诚信	66,816	500,451.84	0.18
17	000157	中联重科	140,300	499,468.00	0.18
18	600308	华泰股份	114,800	499,380.00	0.18
19	600153	建发股份	70,600	497,730.00	0.18
20	603588	高能环境	63,240	496,434.00	0.18
21	600050	中国联通	95,900	495,803.00	0.18
22	601567	三星医疗	87,700	493,751.00	0.18
23	002406	远东传动	93,300	493,557.00	0.18
24	600710	苏美达	133,297	491,865.93	0.18
25	600894	广日股份	89,200	486,140.00	0.18
26	002150	通润装备	76,800	476,160.00	0.18
27	300323	华灿光电	65,500	473,565.00	0.17
28	600482	中国动力	18,100	403,087.00	0.15
29	000069	华侨城 A	57,400	364,490.00	0.13
30	601900	南方传媒	42,200	355,324.00	0.13
31	600177	雅戈尔	48,400	347,996.00	0.13
32	600483	福能股份	40,600	345,100.00	0.13
33	300388	国祯环保	38,400	339,840.00	0.13

34	002561	徐家汇	43,900	338,030.00	0.12
35	600292	远达环保	68,500	337,705.00	0.12
36	600033	福建高速	113,700	337,689.00	0.12
37	002546	新联电子	89,400	337,038.00	0.12
38	603298	杭叉集团	28,500	336,870.00	0.12
39	600590	泰豪科技	62,300	335,797.00	0.12
40	002003	伟星股份	47,800	335,556.00	0.12
41	002449	国星光电	32,300	335,274.00	0.12
42	600697	欧亚集团	18,200	334,698.00	0.12
43	002688	金河生物	74,800	333,608.00	0.12
44	000036	华联控股	60,400	332,804.00	0.12
45	601601	中国太保	11,700	332,631.00	0.12
46	600713	南京医药	78,000	332,280.00	0.12
47	000888	峨眉山 A	58,700	332,242.00	0.12
48	000425	徐工机械	102,800	332,044.00	0.12
49	601607	上海医药	19,500	331,500.00	0.12
50	002247	聚力文化	71,100	331,326.00	0.12
51	603306	华懋科技	23,240	331,170.00	0.12
52	601857	中国石油	45,900	330,939.00	0.12
53	000402	金融街	51,300	330,372.00	0.12
54	000601	韶能股份	88,700	329,964.00	0.12
55	000965	天保基建	85,700	329,945.00	0.12
56	603669	灵康药业	33,300	329,670.00	0.12
57	600356	恒丰纸业	60,000	329,400.00	0.12
58	002081	金螳螂	40,600	328,860.00	0.12
59	002610	爱康科技	209,300	328,601.00	0.12
60	300237	美晨生态	90,100	327,063.00	0.12
61	300172	中电环保	62,452	325,999.44	0.12
62	600880	博瑞传播	87,800	325,738.00	0.12
63	002193	如意集团	36,700	321,492.00	0.12
64	300219	鸿利智汇	41,700	319,422.00	0.12

65	002404	嘉欣丝绸	59,400	317,790.00	0.12
66	000531	穗恒运 A	61,300	310,178.00	0.11
67	000650	仁和药业	56,100	307,428.00	0.11
68	600028	中国石化	60,100	303,505.00	0.11
69	002383	合众思壮	25,200	298,116.00	0.11
70	600015	华夏银行	40,300	297,817.00	0.11
71	300136	信维通信	13,500	291,735.00	0.11
72	601288	农业银行	77,300	278,280.00	0.10
73	601628	中国人寿	13,200	269,148.00	0.10
74	603035	常熟汽饰	21,300	257,730.00	0.10
75	600830	香溢融通	52,900	253,391.00	0.09
76	601018	宁波港	74,500	248,830.00	0.09
77	002468	申通快递	15,100	248,395.00	0.09
78	000551	创元科技	42,100	244,601.00	0.09
79	600790	轻纺城	62,400	227,760.00	0.08
80	601336	新华保险	4,700	198,528.00	0.07
81	600999	招商证券	13,269	177,804.60	0.07
82	600490	鹏欣资源	38,800	176,540.00	0.07
83	600323	瀚蓝环境	12,500	175,375.00	0.06
84	600795	国电电力	68,000	174,080.00	0.06
85	300196	长海股份	19,700	173,951.00	0.06
86	600741	华域汽车	9,400	172,960.00	0.06
87	300045	华力创通	22,800	172,824.00	0.06
88	600979	广安爱众	43,100	172,400.00	0.06
89	000776	广发证券	13,500	171,180.00	0.06
90	603020	爱普股份	23,000	170,890.00	0.06
91	300190	维尔利	34,637	170,414.04	0.06
92	601339	百隆东方	30,800	170,324.00	0.06
93	002706	良信电器	27,400	169,058.00	0.06
94	002083	孚日股份	34,200	168,606.00	0.06
95	600285	羚锐制药	22,400	168,448.00	0.06

96	600390	五矿资本	24,200	168,432.00	0.06
97	300546	雄帝科技	6,500	168,350.00	0.06
98	601009	南京银行	26,000	167,960.00	0.06
99	600219	南山铝业	79,600	167,956.00	0.06
100	600337	美克家居	42,500	167,875.00	0.06
101	601229	上海银行	15,000	167,850.00	0.06
102	002036	联创电子	19,500	167,700.00	0.06
103	600675	中华企业	30,000	167,400.00	0.06
104	600780	通宝能源	51,800	167,314.00	0.06
105	601908	京运通	53,100	167,265.00	0.06
106	600893	航发动力	7,700	167,244.00	0.06
107	002498	汉缆股份	84,000	167,160.00	0.06
108	600887	伊利股份	7,300	167,024.00	0.06
109	603708	家家悦	8,300	166,747.00	0.06
110	603088	宁波精达	14,700	166,698.00	0.06
111	600616	金枫酒业	35,000	166,600.00	0.06
112	000767	漳泽电力	67,400	166,478.00	0.06
113	600322	天房发展	51,200	166,400.00	0.06
114	000715	中兴商业	28,600	166,166.00	0.06
115	600586	金晶科技	58,700	166,121.00	0.06
116	002531	天顺风能	37,300	165,985.00	0.06
117	601998	中信银行	30,400	165,680.00	0.06
118	600865	百大集团	29,800	165,390.00	0.06
119	002380	科远股份	15,700	165,321.00	0.06
120	600537	亿晶光电	58,400	165,272.00	0.06
121	600995	文山电力	25,000	165,250.00	0.06
122	603729	龙韵股份	10,700	165,208.00	0.06
123	002391	长青股份	15,649	165,096.95	0.06
124	002025	航天电器	7,700	165,011.00	0.06
125	000862	银星能源	55,672	164,789.12	0.06
126	600577	精达股份	55,400	164,538.00	0.06



127	000875	吉电股份	67,100	164,395.00	0.06
128	002232	启明信息	24,200	164,318.00	0.06
129	000619	海螺型材	31,600	164,004.00	0.06
130	600509	天富能源	45,900	163,863.00	0.06
131	300485	赛升药业	16,700	163,827.00	0.06
132	600797	浙大网新	22,700	163,667.00	0.06
133	600479	千金药业	21,000	162,960.00	0.06
134	601318	中国平安	2,900	162,690.00	0.06
135	601588	北辰实业	60,000	162,600.00	0.06
136	000900	现代投资	41,700	162,213.00	0.06
137	300239	东宝生物	43,800	162,060.00	0.06
138	002783	凯龙股份	25,200	162,036.00	0.06
139	300421	力星股份	12,800	161,920.00	0.06
140	300434	金石东方	18,400	161,920.00	0.06
141	000050	深天马 A	16,500	161,865.00	0.06
142	600665	天地源	47,000	161,680.00	0.06
143	300118	东方日升	28,400	161,596.00	0.06
144	600353	旭光股份	40,400	161,196.00	0.06
145	300121	阳谷华泰	18,800	160,552.00	0.06
146	600845	宝信软件	7,700	160,545.00	0.06
147	603968	醋化股份	12,700	160,528.00	0.06
148	000042	中洲控股	14,300	160,446.00	0.06
149	300040	九洲电气	32,600	160,392.00	0.06
150	603858	步长制药	6,330	160,022.40	0.06
151	002682	龙洲股份	37,100	159,530.00	0.06
152	300303	聚飞光电	65,600	159,408.00	0.06
153	600018	上港集团	30,700	159,026.00	0.06
154	002456	欧菲科技	17,300	158,987.00	0.06
155	000922	佳电股份	23,600	158,356.00	0.06
156	600562	国睿科技	12,100	155,727.00	0.06
157	603168	莎普爱思	22,200	152,070.00	0.06

158	600257	大湖股份	32,800	137,104.00	0.05
159	600510	黑牡丹	22,200	134,532.00	0.05
160	601599	鹿港文化	39,700	123,864.00	0.05
161	002467	二六三	23,800	120,428.00	0.04
162	601216	君正集团	35,800	93,796.00	0.03
163	600371	万向德农	14,200	88,750.00	0.03
164	300403	汉宇集团	14,200	71,284.00	0.03
165	600481	双良节能	20,400	67,932.00	0.03
166	300089	文化长城	12,500	66,375.00	0.02
167	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
168	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.02
169	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.02
170	601126	四方股份	2,900	14,761.00	0.01
171	002433	太安堂	1,200	5,628.00	-

#### 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	600426	华鲁恒升	45,603,922.30	23.58
2	002078	太阳纸业	34,583,715.95	17.89
3	600642	申能股份	34,301,642.47	17.74
4	002179	中航光电	31,495,248.99	16.29
5	603589	口子窖	31,024,950.79	16.04
6	000778	新兴铸管	30,096,037.39	15.56
7	600201	生物股份	30,089,669.07	15.56
8	000690	宝新能源	30,012,794.48	15.52
9	002195	二三四五	29,172,718.00	15.09
10	600755	厦门国贸	28,861,937.66	14.93
11	002422	科伦药业	28,617,872.48	14.80

12	300182	捷成股份	28,590,830.78	14.79
13	000418	小天鹅 A	28,251,835.97	14.61
14	000656	金科股份	28,063,388.77	14.51
15	600256	广汇能源	28,045,841.25	14.50
16	000581	威孚高科	27,010,129.55	13.97
17	603369	今世缘	26,732,446.59	13.83
18	600525	长园集团	26,595,288.49	13.75
19	000066	中国长城	26,584,312.04	13.75
20	600062	华润双鹤	26,228,278.92	13.56
21	002244	滨江集团	25,547,640.00	13.21
22	600511	国药股份	25,279,997.17	13.07
23	000997	新大陆	25,067,017.98	12.96
24	600655	豫园股份	24,143,131.19	12.49
25	600056	中国医药	24,030,157.02	12.43
26	600600	青岛啤酒	23,644,628.84	12.23
27	000039	中集集团	23,293,973.42	12.05
28	002013	中航机电	23,110,535.06	11.95
29	002589	瑞康医药	22,935,668.18	11.86
30	002038	双鹭药业	22,491,941.17	11.63
31	002410	广联达	22,415,159.02	11.59
32	600143	金发科技	22,099,898.00	11.43
33	601168	西部矿业	21,505,642.29	11.12
34	300088	长信科技	21,331,037.00	11.03
35	000977	浪潮信息	21,152,600.25	10.94
36	000703	恒逸石化	20,858,241.52	10.79
37	002439	启明星辰	20,730,356.85	10.72
38	300383	光环新网	20,369,855.53	10.53
39	002223	鱼跃医疗	20,000,871.80	10.34
40	600879	航天电子	19,818,064.12	10.25
41	300274	阳光电源	19,649,347.35	10.16
42	000999	华润三九	19,571,309.67	10.12

43	000541	佛山照明	19,337,934.25	10.00
44	600282	南钢股份	19,229,102.37	9.94
45	002191	劲嘉股份	19,150,813.33	9.90
46	600875	东方电气	18,980,121.82	9.82
47	601233	桐昆股份	18,931,499.29	9.79
48	600859	王府井	18,868,679.00	9.76
49	600260	凯乐科技	18,863,423.59	9.76
50	600176	中国巨石	18,721,488.21	9.68
51	000887	中鼎股份	18,624,900.02	9.63
52	000786	北新建材	18,560,655.66	9.60
53	600004	白云机场	18,362,790.50	9.50
54	600884	杉杉股份	18,327,720.00	9.48
55	002152	广电运通	18,209,912.79	9.42
56	000937	冀中能源	18,149,389.10	9.39
57	000078	海王生物	18,134,352.60	9.38
58	600584	长电科技	17,915,458.40	9.27
59	000848	承德露露	17,800,514.97	9.21
60	002299	圣农发展	17,781,569.88	9.20
61	002463	沪电股份	17,480,166.73	9.04
62	600466	蓝光发展	17,220,115.80	8.91
63	600967	内蒙一机	17,086,120.99	8.84
64	000598	兴蓉环境	17,045,918.00	8.82
65	600572	康恩贝	17,019,935.62	8.80
66	000547	航天发展	17,015,202.57	8.80
67	300287	飞利信	17,011,076.55	8.80
68	002050	三花智控	16,904,465.00	8.74
69	600079	人福医药	16,895,699.81	8.74
70	002221	东华能源	16,784,654.91	8.68
71	600970	中材国际	16,779,326.82	8.68
72	002056	横店东磁	16,722,422.59	8.65
73	600808	马钢股份	16,721,098.44	8.65

74	600673	东阳光科	16,646,205.65	8.61
75	601717	郑煤机	16,454,438.92	8.51
76	600266	北京城建	16,407,358.36	8.49
77	600315	上海家化	16,381,032.98	8.47
78	600611	大众交通	16,364,891.68	8.46
79	600633	浙数文化	16,285,114.76	8.42
80	002268	卫士通	16,261,896.45	8.41
81	000667	美好置业	16,101,591.62	8.33
82	000596	古井贡酒	16,082,037.95	8.32
83	600863	内蒙华电	16,058,726.84	8.30
84	002440	闰土股份	15,917,268.84	8.23
85	600521	华海药业	15,874,691.31	8.21
86	600729	重庆百货	15,857,912.52	8.20
87	600835	上海机电	15,658,103.11	8.10
88	002444	巨星科技	15,564,065.21	8.05
89	600718	东软集团	15,530,534.27	8.03
90	600557	康缘药业	15,442,239.71	7.99
91	002491	通鼎互联	15,437,820.15	7.98
92	000089	深圳机场	15,374,731.05	7.95
93	000536	华映科技	15,228,128.53	7.88
94	000685	中山公用	15,210,434.01	7.87
95	000729	燕京啤酒	15,187,429.00	7.85
96	000090	天健集团	15,128,011.45	7.82
97	002603	以岭药业	15,119,275.43	7.82
98	002311	海大集团	15,107,703.00	7.81
99	600138	中青旅	14,985,786.47	7.75
100	000552	靖远煤电	14,948,500.00	7.73
101	002127	南极电商	14,915,983.54	7.71
102	000009	中国宝安	14,832,978.05	7.67
103	600578	京能电力	14,758,803.38	7.63
104	002233	塔牌集团	14,731,288.00	7.62

105	600839	四川长虹	14,645,018.00	7.57
106	000027	深圳能源	14,595,854.64	7.55
107	000012	南玻A	14,533,224.49	7.52
108	601678	滨化股份	14,487,570.11	7.49
109	600872	中炬高新	14,451,089.93	7.47
110	600582	天地科技	14,414,333.00	7.45
111	000686	东北证券	14,412,872.69	7.45
112	000028	国药一致	14,411,709.94	7.45
113	600098	广州发展	14,357,502.93	7.43
114	600978	宜华生活	14,217,635.20	7.35
115	002373	千方科技	14,171,155.06	7.33
116	600160	巨化股份	14,129,416.10	7.31
117	601098	中南传媒	14,068,049.93	7.28
118	600037	歌华有线	14,059,486.90	7.27
119	000960	锡业股份	13,975,318.97	7.23
120	600395	盘江股份	13,944,264.74	7.21
121	600801	华新水泥	13,923,374.79	7.20
122	300026	红日药业	13,877,594.00	7.18
123	002004	华邦健康	13,866,726.97	7.17
124	002563	森马服饰	13,840,281.96	7.16
125	600500	中化国际	13,812,280.00	7.14
126	000998	隆平高科	13,724,231.73	7.10
127	600694	大商股份	13,673,469.28	7.07
128	600183	生益科技	13,641,509.96	7.05
129	000636	风华高科	13,603,567.00	7.04
130	600195	中牧股份	13,543,328.91	7.00
131	002482	广田集团	13,479,732.27	6.97
132	603899	晨光文具	13,438,558.33	6.95
133	600240	华业资本	13,369,417.73	6.91
134	601000	唐山港	13,341,997.69	6.90
135	600565	迪马股份	13,339,479.00	6.90

136	000975	银泰资源	13,316,987.20	6.89
137	600064	南京高科	13,279,495.25	6.87
138	300133	华策影视	13,074,680.27	6.76
139	000969	安泰科技	13,054,154.93	6.75
140	000519	中兵红箭	12,872,788.91	6.66
141	000543	皖能电力	12,753,160.65	6.60
142	600580	卧龙电气	12,697,195.81	6.57
143	600664	哈药股份	12,661,635.94	6.55
144	600566	济川药业	12,661,086.24	6.55
145	000926	福星股份	12,618,412.00	6.53
146	600885	宏发股份	12,586,511.13	6.51
147	601006	大秦铁路	12,549,465.89	6.49
148	002465	海格通信	12,546,822.77	6.49
149	002001	新 和 成	12,442,089.67	6.43
150	600060	海信电器	12,409,679.46	6.42
151	600754	锦江股份	12,363,468.48	6.39
152	002390	信邦制药	12,297,794.64	6.36
153	300039	上海凯宝	12,290,953.00	6.36
154	000990	诚志股份	12,236,218.23	6.33
155	600277	亿利洁能	12,112,803.51	6.26
156	002271	东方雨虹	12,041,018.05	6.23
157	000021	深科技	12,020,005.14	6.22
158	600881	亚泰集团	11,912,464.04	6.16
159	600094	大名城	11,879,766.58	6.14
160	000758	中色股份	11,820,199.32	6.11
161	600022	山东钢铁	11,774,250.00	6.09
162	000727	华东科技	11,750,059.00	6.08
163	000661	长春高新	11,716,355.12	6.06
164	600366	宁波韵升	11,689,857.29	6.05
165	000050	深天马 A	11,676,943.07	6.04
166	000400	许继电气	11,613,704.33	6.01

167	000860	顺鑫农业	11,596,268.03	6.00
168	002332	仙琚制药	11,499,699.23	5.95
169	600750	江中药业	11,449,757.10	5.92
170	600216	浙江医药	11,440,471.01	5.92
171	600317	营口港	11,413,959.00	5.90
172	000488	晨鸣纸业	11,385,739.40	5.89
173	603328	依顿电子	11,319,565.25	5.85
174	601311	骆驼股份	11,272,241.78	5.83
175	600270	外运发展	11,266,509.76	5.83
176	002416	爱施德	11,255,597.57	5.82
177	002129	中环股份	11,193,206.00	5.79
178	600748	上实发展	11,183,773.73	5.78
179	600438	通威股份	11,088,174.14	5.73
180	002028	思源电气	11,029,711.02	5.70
181	002317	众生药业	11,020,174.39	5.70
182	000501	鄂武商 A	11,008,196.79	5.69
183	002073	软控股份	10,964,285.00	5.67
184	002064	华峰氨纶	10,932,173.59	5.65
185	000528	柳工	10,926,519.57	5.65
186	002180	纳思达	10,910,068.63	5.64
187	600649	城投控股	10,907,089.99	5.64
188	300257	开山股份	10,893,553.00	5.63
189	600298	安琪酵母	10,875,167.98	5.62
190	600827	百联股份	10,826,421.41	5.60
191	000878	云南铜业	10,822,969.00	5.60
192	002588	史丹利	10,674,770.96	5.52
193	002426	胜利精密	10,666,592.49	5.52
194	600380	健康元	10,641,097.63	5.50
195	601179	中国西电	10,541,923.00	5.45
196	600811	东方集团	10,533,729.39	5.45
197	600623	华谊集团	10,373,048.00	5.36



198	600717	天津港	10,325,092.00	5.34
199	600269	赣粤高速	10,272,528.00	5.31
200	600348	阳泉煤业	10,214,211.00	5.28
201	600017	日照港	10,206,381.00	5.28
202	601928	凤凰传媒	10,188,564.48	5.27
203	600823	世茂股份	10,168,322.00	5.26
204	002277	友阿股份	10,156,001.00	5.25
205	600757	长江传媒	10,130,957.00	5.24
206	600126	杭钢股份	10,119,765.18	5.23
207	300058	蓝色光标	10,094,100.86	5.22
208	601231	环旭电子	10,089,851.37	5.22
209	000988	华工科技	10,068,265.00	5.21
210	002032	苏泊尔	10,003,992.72	5.17
211	000513	丽珠集团	9,943,276.80	5.14
212	000830	鲁西化工	9,901,453.55	5.12
213	001696	宗申动力	9,727,870.00	5.03
214	002583	海能达	9,684,095.79	5.01
215	002280	联络互动	9,649,372.00	4.99
216	300297	蓝盾股份	9,587,315.65	4.96
217	002093	国脉科技	9,487,970.33	4.91
218	600563	法拉电子	9,477,373.65	4.90
219	300315	掌趣科技	9,429,736.00	4.88
220	600422	昆药集团	9,398,828.48	4.86
221	002092	中泰化学	9,397,797.59	4.86
222	600639	浦东金桥	9,365,311.00	4.84
223	600585	海螺水泥	9,297,089.78	4.81
224	603025	大豪科技	9,240,369.16	4.78
225	300113	顺网科技	9,185,575.89	4.75
226	002051	中工国际	9,153,756.40	4.73
227	300055	万邦达	9,152,910.80	4.73
228	600267	海正药业	9,104,393.00	4.71

229	002642	荣之联	9,064,156.00	4.69
230	600597	光明乳业	9,047,573.69	4.68
231	002640	跨境通	9,045,664.00	4.68
232	000563	陕国投 A	9,016,271.54	4.66
233	600657	信达地产	8,868,753.98	4.59
234	600169	太原重工	8,867,684.00	4.59
235	002276	万马股份	8,786,433.10	4.54
236	300159	新研股份	8,700,366.00	4.50
237	002022	科华生物	8,691,825.58	4.50
238	000718	苏宁环球	8,657,254.56	4.48
239	002176	江特电机	8,653,525.52	4.48
240	000031	中粮地产	8,561,932.56	4.43
241	002304	洋河股份	8,427,369.48	4.36
242	000761	本钢板材	8,400,288.00	4.34
243	600284	浦东建设	8,361,062.80	4.32
244	603019	中科曙光	8,322,895.00	4.30
245	000902	新洋丰	8,293,039.00	4.29
246	000825	太钢不锈	8,280,671.84	4.28
247	300002	神州泰岳	8,266,038.98	4.27
248	600346	恒力股份	8,104,100.08	4.19
249	600325	华发股份	8,072,541.92	4.17
250	002663	普邦股份	8,066,698.40	4.17
251	600548	深高速	8,062,935.89	4.17
252	000750	国海证券	8,008,267.06	4.14
253	600486	扬农化工	8,001,210.49	4.14
254	600651	飞乐音响	7,923,169.00	4.10
255	600787	中储股份	7,652,502.32	3.96
256	000970	中科三环	7,612,193.00	3.94
257	600894	广日股份	7,608,445.72	3.93
258	600141	兴发集团	7,591,585.80	3.93
259	002344	海宁皮城	7,583,416.93	3.92

260	600936	广西广电	7,565,134.00	3.91
261	002250	联化科技	7,558,720.60	3.91
262	603766	隆鑫通用	7,558,613.88	3.91
263	600409	三友化工	7,554,227.21	3.91
264	000156	华数传媒	7,521,419.54	3.89
265	002400	省广集团	7,475,175.00	3.87
266	300166	东方国信	7,459,023.05	3.86
267	600993	马应龙	7,454,654.47	3.86
268	603288	海天味业	7,425,340.06	3.84
269	600643	爱建集团	7,423,297.25	3.84
270	600900	长江电力	7,406,666.00	3.83
271	600028	中国石化	7,358,135.00	3.81
272	600743	华远地产	7,344,832.28	3.80
273	000062	深圳华强	7,307,261.51	3.78
274	002544	杰赛科技	7,186,180.00	3.72
275	002048	宁波华翔	7,133,194.25	3.69
276	002019	亿帆医药	7,124,026.00	3.68
277	601801	皖新传媒	7,098,321.30	3.67
278	000592	平潭发展	7,092,860.00	3.67
279	002266	浙富控股	6,989,172.60	3.61
280	000829	天音控股	6,987,071.99	3.61
281	002518	科士达	6,956,457.00	3.60
282	600410	华胜天成	6,938,328.63	3.59
283	300146	汤臣倍健	6,896,311.00	3.57
284	600765	中航重机	6,847,110.00	3.54
285	002340	格林美	6,819,363.00	3.53
286	600151	航天机电	6,805,816.00	3.52
287	600777	新潮能源	6,795,828.00	3.51
288	601016	节能风电	6,761,625.55	3.50
289	002399	海普瑞	6,756,259.20	3.49
290	000030	富奥股份	6,704,080.00	3.47

291	600125	铁龙物流	6,614,351.00	3.42
292	600292	远达环保	6,552,590.33	3.39
293	002635	安洁科技	6,507,643.00	3.37
294	603885	吉祥航空	6,444,716.39	3.33
295	601222	林洋能源	6,418,289.00	3.32
296	600006	东风汽车	6,410,503.62	3.32
297	000049	德赛电池	6,377,699.04	3.30
298	600236	桂冠电力	6,369,393.00	3.29
299	000061	农产品	6,369,194.31	3.29
300	002503	搜于特	6,350,317.17	3.28
301	002600	领益智造	6,317,281.42	3.27
302	600416	湘电股份	6,146,168.46	3.18
303	600170	上海建工	6,144,547.00	3.18
304	000818	航锦科技	6,101,395.00	3.16
305	601001	大同煤业	6,063,344.59	3.14
306	600026	中远海能	5,959,234.24	3.08
307	002308	威创股份	5,956,853.39	3.08
308	600108	亚盛集团	5,923,823.00	3.06
309	002396	星网锐捷	5,887,341.75	3.04
310	600522	中天科技	5,863,603.50	3.03
311	601567	三星医疗	5,839,720.00	3.02
312	600350	山东高速	5,832,334.86	3.02
313	300114	中航电测	5,805,725.12	3.00
314	601601	中国太保	5,804,049.50	3.00
315	600219	南山铝业	5,796,395.00	3.00
316	600674	川投能源	5,785,565.00	2.99
317	601857	中国石油	5,783,133.29	2.99
318	600635	大众公用	5,755,444.00	2.98
319	600640	号百控股	5,724,107.84	2.96
320	601107	四川成渝	5,698,206.99	2.95
321	600021	上海电力	5,642,308.82	2.92

322	300202	聚龙股份	5,591,028.34	2.89
323	002249	大洋电机	5,583,287.00	2.89
324	600519	贵州茅台	5,570,645.77	2.88
325	600073	上海梅林	5,546,385.52	2.87
326	002025	航天电器	5,473,780.44	2.83
327	000612	焦作万方	5,445,827.08	2.82
328	002254	泰和新材	5,443,271.00	2.82
329	000719	中原传媒	5,427,004.33	2.81
330	002375	亚厦股份	5,418,139.27	2.80
331	600388	龙净环保	5,409,414.89	2.80
332	600171	上海贝岭	5,404,786.00	2.80
333	600737	中粮糖业	5,396,286.11	2.79
334	600594	益佰制药	5,374,067.20	2.78
335	601966	玲珑轮胎	5,348,407.08	2.77
336	002251	步步高	5,334,483.97	2.76
337	601699	潞安环能	5,303,260.00	2.74
338	000158	常山北明	5,299,356.10	2.74
339	600704	物产中大	5,266,141.19	2.72
340	000738	航发控制	5,259,588.07	2.72
341	601288	农业银行	5,209,430.00	2.69
342	600184	光电股份	5,181,611.90	2.68
343	600337	美克家居	5,174,270.00	2.68
344	600551	时代出版	5,165,204.74	2.67
345	002414	高德红外	5,140,753.79	2.66
346	002391	长青股份	5,132,496.96	2.65
347	600837	海通证券	5,127,469.00	2.65
348	600618	氯碱化工	5,077,433.39	2.63
349	600161	天坛生物	5,069,404.01	2.62
350	600895	张江高科	5,043,031.00	2.61
351	300010	立思辰	4,995,209.00	2.58
352	002484	江海股份	4,976,439.30	2.57

353	002261	拓维信息	4,965,724.88	2.57
354	603001	奥康国际	4,957,615.98	2.56
355	000762	西藏矿业	4,952,891.52	2.56
356	002707	众信旅游	4,943,292.00	2.56
357	600458	时代新材	4,934,380.24	2.55
358	600039	四川路桥	4,926,715.00	2.55
359	000652	泰达股份	4,845,232.00	2.51
360	600300	维维股份	4,816,524.00	2.49
361	000568	泸州老窖	4,815,084.00	2.49
362	600153	建发股份	4,811,213.90	2.49
363	002745	木林森	4,784,067.00	2.47
364	600739	辽宁成大	4,773,495.98	2.47
365	600329	中新药业	4,762,190.00	2.46
366	002815	崇达技术	4,759,073.00	2.46
367	600316	洪都航空	4,753,656.69	2.46
368	002353	杰瑞股份	4,727,850.96	2.45
369	600688	上海石化	4,699,766.95	2.43
370	002273	水晶光电	4,674,801.15	2.42
371	000006	深振业 A	4,638,570.00	2.40
372	603198	迎驾贡酒	4,629,253.00	2.39
373	300098	高新兴	4,614,173.60	2.39
374	000426	兴业矿业	4,608,177.99	2.38
375	002334	英威腾	4,605,510.00	2.38
376	600971	恒源煤电	4,545,775.76	2.35
377	601333	广深铁路	4,500,832.60	2.33
378	000681	视觉中国	4,480,676.84	2.32
379	601588	北辰实业	4,446,801.99	2.30
380	601318	中国平安	4,443,486.00	2.30
381	601088	中国神华	4,422,125.00	2.29
382	002345	潮宏基	4,416,258.00	2.28
383	603556	海兴电力	4,413,529.00	2.28

384	002242	九阳股份	4,410,100.68	2.28
385	603806	福斯特	4,402,082.40	2.28
386	002183	怡亚通	4,351,649.57	2.25
387	603658	安图生物	4,349,745.20	2.25
388	002358	森源电气	4,343,188.43	2.25
389	600057	厦门象屿	4,341,832.07	2.25
390	600406	国电南瑞	4,324,021.57	2.24
391	600058	五矿发展	4,302,958.00	2.23
392	601689	拓普集团	4,293,174.00	2.22
393	002383	合众思壮	4,291,551.75	2.22
394	603609	禾丰牧业	4,272,930.18	2.21
395	600741	华域汽车	4,264,796.00	2.21
396	002681	奋达科技	4,246,723.76	2.20
397	600155	华创阳安	4,218,790.00	2.18
398	600598	北大荒	4,212,300.85	2.18
399	601608	中信重工	4,208,364.00	2.18
400	600009	上海机场	4,200,980.11	2.17
401	002128	露天煤业	4,199,292.00	2.17
402	002546	新联电子	4,190,699.00	2.17
403	300040	九洲电气	4,187,710.33	2.17
404	601398	工商银行	4,186,060.00	2.16
405	603979	金诚信	4,167,136.04	2.16
406	000930	中粮生化	4,143,778.00	2.14
407	601777	力帆股份	4,142,088.57	2.14
408	300408	三环集团	4,137,782.78	2.14
409	600120	浙江东方	4,116,172.25	2.13
410	600705	中航资本	4,110,348.00	2.13
411	000877	天山股份	4,103,207.00	2.12
412	002296	辉煌科技	4,088,121.50	2.11
413	600478	科力远	4,059,007.78	2.10
414	600307	酒钢宏兴	3,989,939.00	2.06

415	600023	浙能电力	3,989,317.00	2.06
416	000895	双汇发展	3,978,342.20	2.06
417	300308	中际旭创	3,975,229.00	2.06
418	600050	中国联通	3,973,342.00	2.05
419	600312	平高电气	3,957,678.00	2.05
420	002429	兆驰股份	3,943,326.10	2.04
421	002533	金杯电工	3,943,160.08	2.04
422	600335	国机汽车	3,942,442.55	2.04
423	002487	大金重工	3,907,250.00	2.02
424	300324	旋极信息	3,899,216.98	2.02
425	002690	美亚光电	3,892,587.45	2.01
426	002027	分众传媒	3,873,029.29	2.00

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	600426	华鲁恒升	44,032,545.94	22.77
2	600642	申能股份	32,950,568.66	17.04
3	002078	太阳纸业	32,715,138.55	16.92
4	603589	口子窖	32,528,347.49	16.82
5	002179	中航光电	31,766,747.26	16.43
6	002195	二三四五	29,405,521.30	15.21
7	300182	捷成股份	29,111,832.95	15.06
8	600755	厦门国贸	28,979,794.14	14.99
9	002422	科伦药业	28,871,014.52	14.93
10	000778	新兴铸管	28,587,860.00	14.78
11	600525	长园集团	28,543,269.01	14.76
12	000418	小天鹅 A	28,476,776.72	14.73
13	000690	宝新能源	28,155,895.00	14.56



14	000581	威孚高科	27,285,454.84	14.11
15	000656	金科股份	26,661,479.82	13.79
16	600256	广汇能源	26,553,446.29	13.73
17	600201	生物股份	25,994,146.71	13.44
18	603369	今世缘	25,962,998.79	13.43
19	600062	华润双鹤	25,608,723.90	13.24
20	000066	中国长城	25,412,565.12	13.14
21	600056	中国医药	24,970,477.88	12.91
22	000997	新大陆	24,256,520.58	12.54
23	002013	中航机电	24,198,250.35	12.51
24	600511	国药股份	23,882,602.83	12.35
25	002244	滨江集团	23,851,598.42	12.34
26	600655	豫园股份	22,831,394.39	11.81
27	002410	广联达	22,747,533.93	11.76
28	600600	青岛啤酒	22,453,992.81	11.61
29	002589	瑞康医药	21,935,709.70	11.34
30	000703	恒逸石化	21,800,957.50	11.27
31	000977	浪潮信息	21,353,303.10	11.04
32	002038	双鹭药业	21,279,140.42	11.00
33	000039	中集集团	20,684,845.84	10.70
34	601233	桐昆股份	20,605,567.90	10.66
35	000786	北新建材	20,559,188.59	10.63
36	002439	启明星辰	20,515,781.42	10.61
37	300088	长信科技	20,212,763.18	10.45
38	300274	阳光电源	20,077,504.03	10.38
39	600143	金发科技	20,036,262.03	10.36
40	002191	劲嘉股份	19,351,170.85	10.01
41	600859	王府井	19,334,227.07	10.00
42	601168	西部矿业	19,213,436.09	9.94
43	600884	杉杉股份	18,940,809.92	9.80
44	600176	中国巨石	18,876,933.26	9.76

45	000937	冀中能源	18,849,676.91	9.75
46	000999	华润三九	18,695,682.42	9.67
47	002223	鱼跃医疗	18,642,570.71	9.64
48	300383	光环新网	18,631,480.26	9.64
49	600004	白云机场	18,428,026.49	9.53
50	600879	航天电子	18,389,480.40	9.51
51	000078	海王生物	18,339,176.75	9.48
52	600572	康恩贝	18,166,020.85	9.39
53	000541	佛山照明	17,942,782.38	9.28
54	600079	人福医药	17,845,006.95	9.23
55	000598	兴蓉环境	17,789,027.00	9.20
56	600282	南钢股份	17,701,602.17	9.15
57	600729	重庆百货	17,637,488.92	9.12
58	002311	海大集团	17,617,126.35	9.11
59	600260	凯乐科技	17,614,384.82	9.11
60	002440	闰土股份	17,561,691.41	9.08
61	600718	东软集团	17,476,989.09	9.04
62	600875	东方电气	17,434,514.42	9.02
63	000887	中鼎股份	17,275,023.60	8.93
64	300287	飞利信	17,238,302.93	8.92
65	002152	广电运通	17,140,844.28	8.86
66	002299	圣农发展	17,108,503.86	8.85
67	002050	三花智控	17,013,808.12	8.80
68	000667	美好置业	16,957,594.65	8.77
69	002491	通鼎互联	16,820,422.92	8.70
70	601717	郑煤机	16,800,169.44	8.69
71	000027	深圳能源	16,787,102.74	8.68
72	600584	长电科技	16,605,144.44	8.59
73	002463	沪电股份	16,595,799.12	8.58
74	600466	蓝光发展	16,573,790.69	8.57
75	600673	东阳光科	16,545,680.79	8.56

76	000848	承德露露	16,541,522.00	8.55
77	600521	华海药业	16,490,626.01	8.53
78	600970	中材国际	16,322,108.71	8.44
79	600557	康缘药业	16,054,487.85	8.30
80	000685	中山公用	16,048,204.21	8.30
81	600967	内蒙一机	15,993,700.49	8.27
82	002221	东华能源	15,804,283.32	8.17
83	601678	滨化股份	15,728,981.65	8.13
84	000596	古井贡酒	15,634,971.04	8.09
85	600808	马钢股份	15,585,609.01	8.06
86	002056	横店东磁	15,479,147.68	8.01
87	600195	中牧股份	15,451,682.36	7.99
88	600315	上海家化	15,371,463.69	7.95
89	600835	上海机电	15,313,393.12	7.92
90	600863	内蒙华电	15,257,259.76	7.89
91	000012	南玻 A	15,238,383.09	7.88
92	000547	航天发展	15,220,110.30	7.87
93	002268	卫士通	15,134,453.25	7.83
94	600582	天地科技	15,064,182.58	7.79
95	600611	大众交通	15,020,532.92	7.77
96	000090	天健集团	14,878,454.91	7.69
97	600138	中青旅	14,822,455.45	7.67
98	000552	靖远煤电	14,783,060.00	7.65
99	000729	燕京啤酒	14,669,433.00	7.59
100	000536	华映科技	14,599,894.09	7.55
101	002233	塔牌集团	14,578,264.92	7.54
102	000089	深圳机场	14,569,743.06	7.53
103	600578	京能电力	14,558,682.68	7.53
104	600633	浙数文化	14,419,707.99	7.46
105	002444	巨星科技	14,417,789.16	7.46
106	002603	以岭药业	14,360,731.40	7.43

107	600565	迪马股份	14,332,437.57	7.41
108	600266	北京城建	14,291,946.59	7.39
109	002127	南极电商	14,066,641.33	7.27
110	600098	广州发展	13,940,700.38	7.21
111	000050	深天马 A	13,790,164.00	7.13
112	300026	红日药业	13,736,976.95	7.10
113	600395	盘江股份	13,694,005.21	7.08
114	600037	歌华有线	13,648,684.71	7.06
115	000400	许继电气	13,648,598.82	7.06
116	600839	四川长虹	13,526,803.00	7.00
117	600664	哈药股份	13,459,483.85	6.96
118	600872	中炬高新	13,447,046.00	6.95
119	600694	大商股份	13,441,572.83	6.95
120	600064	南京高科	13,435,674.50	6.95
121	600566	济川药业	13,432,977.72	6.95
122	000860	顺鑫农业	13,428,570.92	6.94
123	600801	华新水泥	13,405,864.50	6.93
124	600754	锦江股份	13,210,322.15	6.83
125	600240	华业资本	13,203,913.60	6.83
126	600183	生益科技	13,201,962.19	6.83
127	000960	锡业股份	13,151,485.82	6.80
128	603899	晨光文具	13,146,345.20	6.80
129	000009	中国宝安	13,075,767.70	6.76
130	600978	宜华生活	13,036,145.28	6.74
131	600366	宁波韵升	13,032,409.10	6.74
132	300133	华策影视	13,028,149.07	6.74
133	601000	唐山港	13,018,657.10	6.73
134	000028	国药一致	13,002,047.47	6.72
135	002482	广田集团	12,987,519.93	6.72
136	601098	中南传媒	12,922,097.00	6.68
137	000686	东北证券	12,775,301.82	6.61

138	600270	外运发展	12,767,642.92	6.60
139	000969	安泰科技	12,759,911.35	6.60
140	000543	皖能电力	12,710,185.94	6.57
141	000998	隆平高科	12,705,904.00	6.57
142	600094	大名城	12,692,014.93	6.56
143	000519	中兵红箭	12,653,796.32	6.54
144	002001	新和成	12,644,192.77	6.54
145	600885	宏发股份	12,628,793.67	6.53
146	002563	森马服饰	12,619,817.93	6.53
147	600160	巨化股份	12,590,007.68	6.51
148	600500	中化国际	12,582,431.84	6.51
149	600750	江中药业	12,529,275.33	6.48
150	601006	大秦铁路	12,522,491.77	6.48
151	603328	依顿电子	12,475,260.86	6.45
152	000513	丽珠集团	12,442,519.70	6.43
153	002004	华邦健康	12,382,304.00	6.40
154	000661	长春高新	12,370,600.20	6.40
155	000636	风华高科	12,337,850.40	6.38
156	002416	爱施德	12,335,059.64	6.38
157	000021	深科技	12,306,185.00	6.36
158	000975	银泰资源	12,264,102.14	6.34
159	002373	千方科技	12,240,901.59	6.33
160	600580	卧龙电气	12,204,335.89	6.31
161	002271	东方雨虹	11,951,659.90	6.18
162	300039	上海凯宝	11,933,303.39	6.17
163	600277	亿利洁能	11,794,779.22	6.10
164	000990	诚志股份	11,657,052.42	6.03
165	600216	浙江医药	11,597,184.11	6.00
166	002465	海格通信	11,500,561.04	5.95
167	300297	蓝盾股份	11,499,653.00	5.95
168	000727	华东科技	11,492,838.90	5.94

169	600757	长江传媒	11,445,613.21	5.92
170	000926	福星股份	11,303,897.76	5.85
171	600298	安琪酵母	11,238,594.90	5.81
172	000528	柳工	11,153,982.61	5.77
173	002051	中工国际	11,065,677.91	5.72
174	600881	亚泰集团	11,058,395.00	5.72
175	002129	中环股份	11,039,589.00	5.71
176	600060	海信电器	11,022,543.00	5.70
177	002390	信邦制药	10,966,811.00	5.67
178	600317	营口港	10,927,460.00	5.65
179	000501	鄂武商 A	10,872,298.84	5.62
180	600748	上实发展	10,846,500.27	5.61
181	000988	华工科技	10,792,075.52	5.58
182	600022	山东钢铁	10,744,172.00	5.56
183	002332	仙琚制药	10,658,092.06	5.51
184	002180	纳思达	10,652,847.20	5.51
185	002064	华峰氨纶	10,628,538.00	5.50
186	300257	开山股份	10,463,082.05	5.41
187	002073	软控股份	10,459,073.35	5.41
188	600348	阳泉煤业	10,385,875.11	5.37
189	002028	思源电气	10,384,983.38	5.37
190	000758	中色股份	10,349,591.70	5.35
191	600827	百联股份	10,342,306.77	5.35
192	601311	骆驼股份	10,234,143.71	5.29
193	002032	苏泊尔	10,081,438.06	5.21
194	000825	太钢不锈	10,077,244.00	5.21
195	000488	晨鸣纸业	10,055,426.00	5.20
196	002588	史丹利	9,962,079.71	5.15
197	600900	长江电力	9,910,646.68	5.13
198	002317	众生药业	9,852,827.16	5.10
199	002426	胜利精密	9,816,082.50	5.08

200	600623	华谊集团	9,750,240.12	5.04
201	600649	城投控股	9,746,059.85	5.04
202	600651	飞乐音响	9,700,532.74	5.02
203	002277	友阿股份	9,635,669.04	4.98
204	600269	赣粤高速	9,629,103.00	4.98
205	000878	云南铜业	9,527,113.99	4.93
206	600126	杭钢股份	9,469,918.45	4.90
207	600409	三友化工	9,461,541.39	4.89
208	000830	鲁西化工	9,412,727.00	4.87
209	002093	国脉科技	9,411,958.40	4.87
210	001696	宗申动力	9,368,612.99	4.85
211	601179	中国西电	9,344,260.00	4.83
212	600717	天津港	9,322,963.00	4.82
213	600811	东方集团	9,312,550.40	4.82
214	600380	健康元	9,291,930.52	4.81
215	600267	海正药业	9,287,832.65	4.80
216	600563	法拉电子	9,257,538.56	4.79
217	600017	日照港	9,201,612.90	4.76
218	600639	浦东金桥	9,189,037.24	4.75
219	600422	昆药集团	9,157,167.90	4.74
220	000761	本钢板材	9,150,634.00	4.73
221	601928	凤凰传媒	9,149,469.95	4.73
222	300055	万邦达	9,101,803.00	4.71
223	600438	通威股份	9,071,656.53	4.69
224	600325	华发股份	9,056,155.54	4.68
225	000563	陕国投 A	9,039,408.92	4.67
226	600823	世茂股份	8,957,380.49	4.63
227	300058	蓝色光标	8,922,093.96	4.61
228	600585	海螺水泥	8,921,840.17	4.61
229	300113	顺网科技	8,895,523.80	4.60
230	002642	荣之联	8,782,279.79	4.54

231	002280	联络互动	8,766,634.00	4.53
232	603025	大豪科技	8,634,670.84	4.47
233	002276	万马股份	8,565,084.88	4.43
234	002022	科华生物	8,558,118.68	4.43
235	601231	环旭电子	8,555,675.82	4.42
236	300315	掌趣科技	8,541,557.00	4.42
237	002583	海能达	8,494,472.40	4.39
238	000902	新洋丰	8,487,296.18	4.39
239	002503	搜于特	8,485,571.80	4.39
240	600657	信达地产	8,480,688.52	4.39
241	600597	光明乳业	8,434,590.11	4.36
242	000031	中粮地产	8,376,053.68	4.33
243	603019	中科曙光	8,364,597.00	4.33
244	002176	江特电机	8,303,283.60	4.29
245	000030	富奥股份	8,294,488.17	4.29
246	002304	洋河股份	8,257,687.00	4.27
247	600141	兴发集团	8,257,056.16	4.27
248	600169	太原重工	8,256,326.00	4.27
249	000718	苏宁环球	8,174,022.40	4.23
250	002092	中泰化学	8,059,305.76	4.17
251	600346	恒力股份	8,051,200.78	4.16
252	600486	扬农化工	8,014,190.08	4.14
253	600284	浦东建设	8,001,564.20	4.14
254	600743	华远地产	7,964,768.09	4.12
255	600548	深高速	7,909,737.75	4.09
256	002019	亿帆医药	7,849,105.00	4.06
257	600219	南山铝业	7,770,111.00	4.02
258	300159	新研股份	7,768,856.65	4.02
259	002640	跨境通	7,751,476.92	4.01
260	600936	广西广电	7,739,891.62	4.00
261	002400	省广集团	7,527,414.00	3.89



262	002663	普邦股份	7,485,608.18	3.87
263	000156	华数传媒	7,433,673.85	3.84
264	000750	国海证券	7,348,597.00	3.80
265	300002	神州泰岳	7,288,480.76	3.77
266	603766	隆鑫通用	7,234,587.12	3.74
267	600643	爱建集团	7,223,683.71	3.74
268	600028	中国石化	7,145,793.12	3.70
269	600894	广日股份	7,144,915.64	3.70
270	600993	马应龙	7,094,949.40	3.67
271	002544	杰赛科技	7,072,352.78	3.66
272	600787	中储股份	7,070,794.78	3.66
273	603288	海天味业	6,972,408.00	3.61
274	002250	联化科技	6,962,364.72	3.60
275	000062	深圳华强	6,940,904.20	3.59
276	600410	华胜天成	6,902,777.56	3.57
277	000592	平潭发展	6,836,242.26	3.54
278	002048	宁波华翔	6,792,301.00	3.51
279	600236	桂冠电力	6,734,952.80	3.48
280	002344	海宁皮城	6,680,605.21	3.45
281	000612	焦作万方	6,676,247.48	3.45
282	002635	安洁科技	6,596,729.69	3.41
283	000970	中科三环	6,593,826.24	3.41
284	601222	林洋能源	6,574,791.50	3.40
285	000829	天音控股	6,563,467.00	3.39
286	002518	科士达	6,513,397.85	3.37
287	002266	浙富控股	6,402,233.00	3.31
288	002399	海普瑞	6,387,201.65	3.30
289	000061	农产品	6,382,627.14	3.30
290	600125	铁龙物流	6,265,368.64	3.24
291	000818	航锦科技	6,234,833.00	3.22
292	300166	东方国信	6,161,633.60	3.19

293	000049	德赛电池	6,129,934.00	3.17
294	300114	中航电测	6,121,403.22	3.17
295	002308	威创股份	6,110,319.47	3.16
296	600292	远达环保	6,108,733.45	3.16
297	600151	航天机电	6,083,679.50	3.15
298	603885	吉祥航空	6,056,105.07	3.13
299	002396	星网锐捷	6,017,613.60	3.11
300	600170	上海建工	6,007,558.00	3.11
301	601016	节能风电	5,987,383.00	3.10
302	601801	皖新传媒	5,979,477.04	3.09
303	002600	领益智造	5,943,968.00	3.07
304	600108	亚盛集团	5,909,955.23	3.06
305	600765	中航重机	5,871,103.08	3.04
306	601001	大同煤业	5,869,769.64	3.04
307	600777	新潮能源	5,803,285.96	3.00
308	600635	大众公用	5,769,232.99	2.98
309	002340	格林美	5,762,975.41	2.98
310	600350	山东高速	5,761,390.32	2.98
311	601567	三星医疗	5,753,623.69	2.98
312	600674	川投能源	5,742,950.31	2.97
313	600026	中远海能	5,741,953.06	2.97
314	600073	上海梅林	5,647,503.42	2.92
315	600519	贵州茅台	5,588,424.00	2.89
316	600522	中天科技	5,571,215.56	2.88
317	600416	湘电股份	5,570,096.41	2.88
318	002815	崇达技术	5,539,759.00	2.86
319	600006	东风汽车	5,521,149.00	2.86
320	600640	号百控股	5,489,309.38	2.84
321	600688	上海石化	5,480,733.43	2.83
322	601107	四川成渝	5,454,507.46	2.82
323	601857	中国石油	5,438,868.00	2.81

324	601601	中国太保	5,434,461.79	2.81
325	600153	建发股份	5,431,199.00	2.81
326	600388	龙净环保	5,419,903.18	2.80
327	000876	新希望	5,396,347.08	2.79
328	300202	聚龙股份	5,381,900.50	2.78
329	002025	航天电器	5,370,755.32	2.78
330	002414	高德红外	5,355,291.08	2.77
331	002358	森源电气	5,349,987.00	2.77
332	002249	大洋电机	5,347,993.00	2.77
333	000652	泰达股份	5,331,576.00	2.76
334	600021	上海电力	5,322,541.71	2.75
335	000738	航发控制	5,294,372.70	2.74
336	002254	泰和新材	5,282,177.00	2.73
337	600704	物产中大	5,279,443.81	2.73
338	601699	潞安环能	5,266,201.02	2.72
339	600039	四川路桥	5,264,412.00	2.72
340	000158	常山北明	5,234,078.10	2.71
341	300010	立思辰	5,198,354.20	2.69
342	600551	时代出版	5,161,425.07	2.67
343	000006	深振业 A	5,093,601.00	2.63
344	002375	亚厦股份	5,086,533.30	2.63
345	600171	上海贝岭	5,081,886.00	2.63
346	600837	海通证券	5,050,782.00	2.61
347	000762	西藏矿业	5,043,372.96	2.61
348	603658	安图生物	5,005,003.12	2.59
349	600458	时代新材	4,961,013.95	2.57
350	600337	美克家居	4,947,765.00	2.56
351	600184	光电股份	4,947,758.25	2.56
352	603001	奥康国际	4,930,158.20	2.55
353	002484	江海股份	4,927,230.54	2.55
354	600316	洪都航空	4,914,151.00	2.54

355	002391	长青股份	4,891,717.10	2.53
356	000719	中原传媒	4,889,247.00	2.53
357	601288	农业银行	4,849,249.00	2.51
358	600329	中新药业	4,840,085.82	2.50
359	600377	宁沪高速	4,834,380.90	2.50
360	300146	汤臣倍健	4,826,185.08	2.50
361	600618	氯碱化工	4,754,238.37	2.46
362	002251	步步高	4,748,161.07	2.46
363	600300	维维股份	4,747,938.51	2.46
364	002063	远光软件	4,710,936.19	2.44
365	300098	高新兴	4,698,446.00	2.43
366	002745	木林森	4,690,219.00	2.43
367	600895	张江高科	4,661,324.00	2.41
368	002261	拓维信息	4,652,646.00	2.41
369	002707	众信旅游	4,601,412.92	2.38
370	002247	聚力文化	4,600,312.00	2.38
371	000568	泸州老窖	4,596,876.00	2.38
372	000426	兴业矿业	4,590,769.50	2.37
373	601811	新华文轩	4,551,368.00	2.35
374	002334	英威腾	4,542,789.00	2.35
375	000895	双汇发展	4,459,654.00	2.31
376	600335	国机汽车	4,450,748.00	2.30
377	002353	杰瑞股份	4,444,348.00	2.30
378	601088	中国神华	4,379,823.22	2.27
379	002183	怡亚通	4,366,786.00	2.26
380	601333	广深铁路	4,346,432.63	2.25
381	002242	九阳股份	4,322,638.48	2.24
382	600406	国电南瑞	4,312,205.95	2.23
383	002273	水晶光电	4,301,394.90	2.22
384	600594	益佰制药	4,294,845.00	2.22
385	002296	辉煌科技	4,292,918.00	2.22

386	600057	厦门象屿	4,287,349.05	2.22
387	600737	中粮糖业	4,276,289.00	2.21
388	601318	中国平安	4,267,589.00	2.21
389	600739	辽宁成大	4,238,660.01	2.19
390	600058	五矿发展	4,213,954.90	2.18
391	000681	视觉中国	4,212,996.00	2.18
392	600009	上海机场	4,180,046.98	2.16
393	600598	北大荒	4,173,846.89	2.16
394	603609	禾丰牧业	4,171,552.00	2.16
395	000877	天山股份	4,169,188.00	2.16
396	002681	奋达科技	4,169,044.18	2.16
397	601966	玲珑轮胎	4,164,652.86	2.15
398	002128	露天煤业	4,133,772.00	2.14
399	600741	华域汽车	4,129,493.17	2.14
400	601398	工商银行	4,123,541.00	2.13
401	601588	北辰实业	4,116,111.01	2.13
402	000930	中粮生化	4,107,982.00	2.12
403	600161	天坛生物	4,088,345.00	2.11
404	002429	兆驰股份	4,072,103.00	2.11
405	600155	华创阳安	4,060,643.18	2.10
406	300408	三环集团	4,060,567.70	2.10
407	600705	中航资本	4,055,868.36	2.10
408	300040	九洲电气	4,048,346.08	2.09
409	600312	平高电气	4,031,932.99	2.09
410	002383	合众思壮	3,983,496.00	2.06
411	600023	浙能电力	3,980,110.00	2.06
412	002690	美亚光电	3,973,633.30	2.06
413	600971	恒源煤电	3,965,256.00	2.05
414	601689	拓普集团	3,951,835.12	2.04
415	603806	福斯特	3,934,907.10	2.03
416	601777	力帆股份	3,933,847.00	2.03

417	300376	易事特	3,928,136.00	2.03
418	002533	金杯电工	3,893,783.16	2.01

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	6,200,546,942.60
卖出股票收入(成交)总额	6,044,068,266.92

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	13,559,400.00	5.01
	其中:政策性金融债	13,559,400.00	5.01
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)	14,965.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,574,365.50	5.01

#### 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	018005	国开1701	135,000	13,559,400.00	5.01
2	110047	山鹰转债	150	14,965.50	0.01

**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	188,562.17
2	应收证券清算款	3,284,158.15
3	应收股利	-
4	应收利息	380,976.17
5	应收申购款	861,716.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,715,413.35

#### 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

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

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 中证5 00增 强A	8,65 5	24,702.38	127,267,897.43	59.53 %	86,531,179.44	40.47%
创金 合信 中证5 00增 强C	5,75 9	24,202.32	71,802,050.89	51.51 %	67,579,126.69	48.49%
合计	14,2 17	24,842.11	199,069,948.32	56.36 %	154,110,306.13	43.64%

#### 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	创金合信中证500增强A	60,804.91	0.03%
	创金合信中证500增强C	294,530.20	0.21%
	合计	355,335.11	0.10%

### 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	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0
	合计	0~10

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	2.83%	10,000,000.00	2.83%	36月
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

基金经理等人员	24,382.31	0.01%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,024,382.31	2.84%	10,000,000.00	2.83%	36月

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
基金合同生效日(2015年12月31日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	177,986,119.86	9,386,823.33
本报告期基金总申购份额	227,657,665.27	264,709,161.72
减：本报告期基金总赎回份额	191,844,708.26	134,714,807.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	213,799,076.87	139,381,177.58

## § 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3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	
英大证券	1	205,409,515.22	1.68%	84,486.74	2.10%	-
第一创业证券	2	4,899,658,945.08	40.03%	1,569,780.21	39.07%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	741,969,413.08	6.06%	311,418.98	7.75%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	2,613,000,378.02	21.35%	839,440.21	20.89%	-
长江证券	2	1,254,229,550.29	10.25%	402,409.72	10.01%	-
安信证券	2	2,525,214,096.98	20.63%	810,660.46	20.17%	-
中信	2	-	-	-	-	-

建投 证券						
----------	--	--	--	--	--	--

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内新增招商证券，广发证券，中信建投证券，英大证券，安信证券，中泰证券、长江证券7家券商的13个交易单元。

### 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
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	12,091,364.93	38.66%	1,500,000.00	1.61%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	3,754,400.50	12.01%	15,000,000.00	16.06%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	9,887,962.00	31.62%	26,000,000.00	27.84%	-	-	-	-
长江证券	-	-	19,900,000.00	21.31%	-	-	-	-
安信证券	5,538,732.00	17.71%	31,000,000.00	33.19%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	公司官网、证券日报	2018-01-19
3	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加苏宁金融为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-01-29
4	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、证券日报	2018-02-10
5	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报	2018-02-13
6	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	公司官网、证券日报	2018-02-13
7	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
8	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
9	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金修订基金合同、托管协议部	公司官网、证券日报	2018-03-28

	分条款及调整赎回费相关规则的公告		
10	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
11	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2018年3月修订）	公司官网、证券日报	2018-03-28
12	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告	公司官网、证券日报	2018-03-31
13	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	公司官网、证券日报	2018-03-31
14	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券日报	2018-04-02
15	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年第1季度报告	公司官网、证券日报	2018-04-19
16	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、证券日报	2018-04-27
17	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-05-17
18	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券日报	2018-05-24
19	创金合信基金管理有限公司	公司官网、证券日报	2018-06-06

	关于旗下部分开放式基金增加广发证券为代销机构暨参加广发证券费率优惠活动的公告		
20	创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	公司官网、证券日报	2018-06-15
21	创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	公司官网、证券日报	2018-06-21
22	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恒泰证券为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-06-29
23	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
24	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、证券日报	2018-07-03
25	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年第2季度报告	公司官网、证券日报	2018-07-20
26	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、证券日报	2018-08-10
27	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2018年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、证券日报	2018-08-13
28	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）	公司官网、证券日报	2018-08-13

29	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和耕传承为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-08-17
30	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年半年度报告	公司官网、证券日报	2018-08-29
31	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券日报	2018-09-01
32	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-09-11
33	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年第3季度报告	公司官网、证券日报	2018-10-25
34	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植信基金为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-10-26
35	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华创证券为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-11-06
36	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中银国际证券为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-11-13
37	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阳光人寿为代销机构的公告	公司官网、证券日报	2018-11-29
38	创金合信中证500指数增强	公司官网、证券日报	2018-12-05



	型发起式证券投资基金基金 经理变更公告		
--	------------------------	--	--

## § 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 - 20180227	170,683,806.27	0.00	131,000,000.00	39,683,806.27	11.24%
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、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告。

### 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](http://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