

# 创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

## 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	75
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	77
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	77
§9 开放式基金份额变动 .....	78
§10 重大事件揭示 .....	79
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
10.4 基金投资策略的改变 .....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
10.8 其他重大事件 .....	80
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
§12 备查文件目录 .....	82
12.1 备查文件目录 .....	82
12.2 存放地点 .....	82
12.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证1000增强	
基金主代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	130,527,094.95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1000增强A	创金合信中证1000增强C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份额总额	53,071,611.72份	77,455,483.23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1000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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	梁绍锋	贺倩
	联系电话	0755-23838908	010-66060069
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95599
传真		0755-25832571	010-68121816
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518000	100031
法定代表人		刘学民	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦15层
--------	--------------	--------------------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
本期已实现收益	4,110,315.89	6,523,055.88
本期利润	4,648,608.41	6,301,848.89
加权平均基金份额本期利润	0.1200	0.1097
本期加权平均净值利润率	12.99%	11.77%
本期基金份额净值增长率	26.26%	25.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	-8,776,122.59	-13,216,526.27
期末可供分配基金份额利润	-0.1654	-0.1706
期末基金资产净值	49,889,122.03	72,406,741.33
期末基金份额净值	0.9400	0.9348
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-6.00%	-6.52%

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1000增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.89%	1.38%	-0.21%	1.45%	1.10%	-0.07%
过去三个月	-5.23%	1.73%	-9.44%	1.84%	4.21%	-0.11%
过去六个月	26.26%	1.68%	19.19%	1.80%	7.07%	-0.12%
过去一年	10.32%	1.59%	-4.62%	1.67%	14.94%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-6.00%	1.31%	-36.36%	1.37%	30.36%	-0.06%

##### 创金合信中证1000增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.86%	1.39%	-0.21%	1.45%	1.07%	-0.06%
过去三个月	-5.40%	1.73%	-9.44%	1.84%	4.04%	-0.11%
过去六个月	25.71%	1.68%	19.19%	1.80%	6.52%	-0.12%
过去一年	9.71%	1.59%	-4.62%	1.67%	14.33%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-6.52%	1.31%	-36.36%	1.37%	29.84%	-0.06%

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





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月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。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。

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。

截至2019年6月30日，本公司共管理40只公募基金，其中混合型产品8只、指数型产品8只、债券型产品14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155.17亿元。

#### 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	2016-12-22	-	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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，本基金与管理人管理的其他投资组合构成同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共15次，与本基金发生反向交易的投资组合为公司量化选股策略的投资组合，同时该产品采用指数化策略进行投资，组合调仓时与量化选股策略投资组合发生反向，该交易未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年上半年，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1000增强A基金份额净值为0.9400元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.26%，同期业绩比较基准收益率为19.19%；截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为0.9348元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.71%，同期业绩比较基准收益率为19.19%。

#### 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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-创金合信基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,636,488.05	801,785.36
结算备付金		2,059,556.21	696,932.85
存出保证金		401,602.89	33,180.97
交易性金融资产	6.4.7.2	118,568,629.41	42,451,516.03
其中：股票投资		112,385,637.41	40,222,935.23
基金投资		-	-
债券投资		6,182,992.00	2,228,580.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,703,735.44	-
应收利息	6.4.7.5	136,379.68	61,785.93
应收股利		-	-
应收申购款		840,582.96	125,567.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		128,346,974.64	44,170,768.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,346,935.83	-
应付赎回款		74,830.27	25,546.94
应付管理人报酬		77,949.12	29,990.46
应付托管费		14,615.45	5,623.23
应付销售服务费		11,815.30	3,993.92
应付交易费用	6.4.7.7	471,061.67	88,543.41
应交税费		0.31	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	53,903.33	170,000.00
负债合计		6,051,111.28	323,698.31
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	130,527,094.95	58,934,800.32
未分配利润	6.4.7.10	-8,231,231.59	-15,087,729.71
所有者权益合计		122,295,863.36	43,847,070.61

负债和所有者权益总计		128,346,974.64	44,170,768.92
------------	--	----------------	---------------

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额130,527,094.95份，其中下属A类基金份额53,071,611.72份，C类基金份额77,455,483.23份。下属A类基金份额净值0.9400元，C类基金份额净值0.9348元。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		13,056,357.29	-13,801,147.12
1. 利息收入		82,408.91	137,234.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,738.19	36,556.62
债券利息收入		62,670.72	99,587.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,090.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,431,155.68	-12,933,323.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,664,508.61	-13,281,531.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	212.80	26,975.89
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-129,806.60	-
股利收益	6.4.7.15	896,240.87	321,232.23

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	317,085.53	-1,088,137.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	225,707.17	83,079.65
<b>减：二、费用</b>		2,105,899.99	3,815,296.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	348,621.45	466,193.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,366.56	87,411.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	51,976.49	25,159.75
4. 交易费用	6.4.7.18	1,570,462.22	3,116,996.10
5. 利息支出		2,215.03	17,127.16
其中：卖出回购金融资产支出		2,215.03	17,127.16
6. 税金及附加		581.76	0.67
7. 其他费用	6.4.7.19	66,676.48	102,408.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,950,457.30	-17,616,444.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,950,457.30	-17,616,444.10

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计



一、期初所有者权益(基金净值)	58,934,800.32	-15,087,729.71	43,847,070.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,950,457.30	10,950,457.30
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)	71,592,294.63	-4,093,959.18	67,498,335.45
其中：1. 基金申购款	153,440,659.07	-11,536,643.64	141,904,015.43
2. 基金赎回款	-81,848,364.44	7,442,684.46	-74,405,679.98
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)	130,527,094.95	-8,231,231.59	122,295,863.36
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	220,669,622.69	-5,362,326.00	215,307,296.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,616,444.10	-17,616,444.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-160,450,641.56	14,073,718.01	-146,376,923.55
其中：1. 基金申购	65,042,060.32	-2,997,428.89	62,044,631.43

款			
2. 基金赎回款	-225,492,701.88	17,071,146.90	-208,421,554.98
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）	60,218,981.13	-8,905,052.09	51,313,929.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信中证1000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[2016]1918号《关于准予创金合信中证1000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1000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10,115,380.08元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1553号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,115,717.42份基金份额,其中认购资金利息折合337.34份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,333.36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1000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1000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、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、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1000指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于2019年6月30日，本基金的基金资产净值为122,295,863.36元，且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019半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2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	3,636,488.05
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	3,636,488.05

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	113,884,739.19	112,385,637.41	-1,499,101.78	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	6,197,605.94	6,182,992.00	-14,613.94
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,197,605.94	6,182,992.00	-14,613.94
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	120,082,345.13	118,568,629.41	-1,513,715.72

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,903,440.00	-	-	-
股指期货	2,903,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,903,440.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	509.49
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	918.43

应收债券利息	134,930.06
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	21.70
合计	136,379.68

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	471,061.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	471,061.67

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	44.83
预提费用	53,858.50
合计	53,903.33

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 创金合信中证1000增强A

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
----	---------------------------

(创金合信中证1000增强A)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,019,851.67	27,019,851.67
本期申购	63,049,192.06	63,049,192.06
本期赎回(以“-”号填列)	-36,997,432.01	-36,997,432.01
本期末	53,071,611.72	53,071,611.72

## 6.4.7.9.2 创金合信中证1000增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	31,914,948.65	31,914,948.65
本期申购	90,391,467.01	90,391,467.01
本期赎回(以“-”号填列)	-44,850,932.43	-44,850,932.43
本期末	77,455,483.23	77,455,483.23

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 创金合信中证1000增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,356,396.21	1,452,713.57	-6,903,682.64
本期利润	4,110,315.89	538,292.52	4,648,608.41
本期基金份额交易产生的变动数	-4,530,042.27	3,602,626.81	-927,415.46
其中：基金申购款	-12,228,637.10	8,737,129.14	-3,491,507.96
基金赎回款	7,698,594.83	-5,134,502.33	2,564,092.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,776,122.59	5,593,632.90	-3,182,489.69

## 6.4.7.10.2 创金合信中证1000增强C



单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,899,925.48	1,715,878.41	-8,184,047.07
本期利润	6,523,055.88	-221,206.99	6,301,848.89
本期基金份额交易产生的变动数	-9,839,656.67	6,673,112.95	-3,166,543.72
其中：基金申购款	-20,311,057.10	12,265,921.42	-8,045,135.68
基金赎回款	10,471,400.43	-5,592,808.47	4,878,591.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,216,526.27	8,167,784.37	-5,048,741.90

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	8,227.66
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	11,214.84
其他	295.69
合计	19,738.19

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	811,523,531.90
减：卖出股票成本总额	799,859,023.29
买卖股票差价收入	11,664,508.61

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	212.80
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	212.80

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,070,536.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,898,832.00
减：应收利息总额	171,492.19
买卖债券差价收入	212.80

## 6.4.7.14 衍生工具收益

## 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无权证收益。

## 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年01月01日至2019年06月30日
期货投资	-129,806.60

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	896,240.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	896,240.87

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	276,685.53
——股票投资	291,048.27
——债券投资	-14,362.74
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	40,400.00
——权证投资	-
——期货投资	40,400.00
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	317,085.53

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	225,307.55
转换费收入	399.62
合计	225,707.17

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	1,569,365.05
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	1,097.17
合计	1,570,462.22

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	28,982.11
汇划手续费	2,817.98
指数使用费	20,000.00
合计	66,676.48

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

经创金合信基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会（证监许可〔2018〕2082号）核准，本公司进行增资扩股。公司注册资本由17,000万元增加至23,300万元，增额注册资本已由新增股东深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）认购并已实缴。本公司《公司章程》的有关条款已根据本次增资情况进行了相应修改。上述事项的工商变更登记手续现已于2019年4月29日办理完毕。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、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
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		股票成交总额的比例		股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,200,774,342.20	71.39%	3,023,656,411.28	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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	4,647,324.30	41.54%	12,375,705.65	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	8,000,000.00	36.53%	70,600,000.00	100.00%

有限公司				
------	--	--	--	--

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	502,918.10	82.66%	471,061.67	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,269,459.84	100.00%	259,532.57	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	348,621.45	466,193.88
其中：支付销售机构的客户维护费	94,258.76	38,470.49

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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,366.56	87,411.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计



创金合信 直销	0.00	34,185.80	34,185.80
合计	0.00	34,185.80	34,185.80
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信 直销	0.00	18,974.45	18,974.45
合计	0.00	18,974.45	18,974.45

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

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5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信中证1000增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年01月01日至2018年06月30日

基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.42%	29.52%

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.46%	11.55%
---------------------	-------	--------

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,636,488.05	8,227.66	805,174.32	10,932.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
6012	红塔	2019	2019	新发	3.46	3.46	9,789	33,8	33,8	-

36	证券	-06- 26	-07- 05	流通 受限				69.9 4	69.9 4	
3007 88	中信 出版	2019 -06- 27	2019 -07- 05	新发 流通 受限	14.8 5	14.8 5	1,556	23,1 06.6 0	23,1 06.6 0	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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： 张）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
1280 68	和而 转债	2019 -06- 04	2019 -07- 01	配债 流通 受限	100. 00	100. 00	212	21,2 00.0 0	21,2 00.0 0	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股 票 代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量（ 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
6005 10	黑牡 丹	2019 -06- 19	重大 事项 停牌	6.32	2019 -07- 03	6.95	17,000	106,834.00	107,440.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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农业银行，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	6,161,792.00	-
合计	6,161,792.00	-

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末

	2019年06月30日	2018年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	21,200.00	28,944.80
未评级	-	2,199,636.00
合计	21,200.00	2,228,580.80

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2019年06月30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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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6.4.12。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2019年6月30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0.15%。

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2019年6月30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125,675,270.40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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,636,488.05	-	-	-	3,636,488.05
结算备付金	2,059,556.21	-	-	-	2,059,556.21
存出保证金	401,602.89	-	-	-	401,602.89
交易性金融资产	6,161,792.00	-	21,200.00	112,385,637.41	118,568,629.41
应收证券清算款	-	-	-	2,703,735.44	2,703,735.44
应收利息	-	-	-	136,379.68	136,379.68
应收申购款	-	-	-	840,582.96	840,582.96
资产总计	12,259,439.15	-	21,200.00	116,066,335.49	128,346,974.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,346,935.83	5,346,935.83
应付赎回款	-	-	-	74,830.27	74,830.27
应付管理人报酬	-	-	-	77,949.12	77,949.12
应付托管费	-	-	-	14,615.45	14,615.45
应付销售服务费	-	-	-	11,815.30	11,815.30
应付交易费用	-	-	-	471,061.67	471,061.67



应交税费	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	53,903.33	53,903.33
负债总计	-	-	-	6,051,111.28	6,051,111.28
利率敏感度缺口	12,259,439.15	-	21,200.00	110,015,224.21	122,295,863.36
上年度末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	801,785.36	-	-	-	801,785.36
结算备付金	696,932.85	-	-	-	696,932.85
存出保证金	33,180.97	-	-	-	33,180.97
交易性金融资产	2,199,636.00	-	28,944.80	40,222,935.23	42,451,516.03
应收利息	-	-	-	61,785.93	61,785.93
应收申购款	-	-	-	125,567.78	125,567.78
资产总计	3,731,535.18	-	28,944.80	40,410,288.94	44,170,768.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,546.94	25,546.94
应付管理人报酬	-	-	-	29,990.46	29,990.46
应付托管费	-	-	-	5,623.23	5,623.23
应付销售服务	-	-	-	3,993.92	3,993.92

费					
应付交易费用	-	-	-	88,543.41	88,543.41
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	323,698.31	323,698.31
利率敏感度缺口	3,731,535.18	-	28,944.80	40,086,590.63	43,847,070.61

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年6月30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5.06%(2017年12月31日：5.08%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018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	112,385,637.41	91.90	40,222,935.23	91.73
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	112,385,637.41	91.90	40,222,935.23	91.73

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位： 人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	5,434,487.67	2,016,052.84
比较基准下降5%资产净值变动	-5,434,487.67	-2,016,052.84	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为112,221,220.87元，属于第二层次的余额为6,347,408.54元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次40,239,864.03元，第二层次2,211,652.00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2019年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	112,385,637.41	87.56

	其中：股票	112,385,637.41	87.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,182,992.00	4.82
	其中：债券	6,182,992.00	4.82
	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	5,696,044.26	4.44
8	其他各项资产	4,082,300.97	3.18
9	合计	128,346,974.64	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	530,405.00	0.43
B	采矿业	2,505,330.00	2.05
C	制造业	59,210,221.52	48.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,768,802.00	3.08
E	建筑业	2,664,842.00	2.18
F	批发和零售业	4,480,556.00	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	2,437,923.00	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,957,927.00	8.14
J	金融业	373,560.00	0.31
K	房地产业	5,138,632.20	4.20

L	租赁和商务服务业	1,204,830.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	316,309.00	0.26
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	644,023.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	93,233,360.72	76.24

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	233,806.00	0.19
B	采矿业	193,129.65	0.16
C	制造业	12,182,881.24	9.96
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	1,432,550.00	1.17
E	建筑业	563,433.00	0.46
F	批发和零售业	945,916.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政 业	119,340.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	1,254,942.26	1.03
J	金融业	242,991.94	0.20
K	房地产业	230,580.00	0.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	120,625.00	0.10
N	水利、环境和公共设施	112,574.00	0.09

	管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	121,040.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,398,467.60	1.14
S	综合	-	-
	合计	19,152,276.69	15.66

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600873	梅花生物	220,400	1,055,716.00	0.86
2	600728	佳都科技	105,900	1,043,115.00	0.85
3	300098	高新兴	125,200	999,096.00	0.82
4	600675	中华企业	186,800	969,492.00	0.79
5	600601	方正科技	248,700	860,502.00	0.70
6	600252	中恒集团	288,800	846,184.00	0.69
7	300038	数知科技	86,000	804,960.00	0.66
8	002413	雷科防务	124,200	793,638.00	0.65
9	002467	二六三	124,400	763,816.00	0.62
10	000683	远兴能源	291,000	759,510.00	0.62
11	600366	宁波韵升	81,700	750,006.00	0.61
12	000591	太阳能	224,000	734,720.00	0.60
13	002099	海翔药业	103,300	733,430.00	0.60
14	002449	国星光电	53,200	706,496.00	0.58
15	601588	北辰实业	188,100	705,375.00	0.58

16	603368	柳药股份	21,400	703,632.00	0.58
17	300118	东方日升	67,900	691,222.00	0.57
18	002203	海亮股份	63,600	688,152.00	0.56
19	601636	旗滨集团	175,000	680,750.00	0.56
20	000059	华锦股份	105,500	675,200.00	0.55
21	002597	金禾实业	36,300	662,112.00	0.54
22	000875	吉电股份	207,200	658,896.00	0.54
23	600185	格力地产	134,900	656,963.00	0.54
24	600850	华东电脑	30,100	640,829.00	0.52
25	601222	林洋能源	135,700	636,433.00	0.52
26	002675	东诚药业	57,900	632,268.00	0.52
27	000921	海信家电	49,800	621,504.00	0.51
28	601058	赛轮轮胎	208,700	619,839.00	0.51
29	600110	诺德股份	139,700	618,871.00	0.51
30	600337	美克家居	150,200	618,824.00	0.51
31	002376	新北洋	51,400	614,230.00	0.50
32	002643	万润股份	60,700	613,070.00	0.50
33	600123	兰花科创	83,500	611,220.00	0.50
34	603660	苏州科达	38,980	607,698.20	0.50
35	600602	云赛智联	78,300	600,561.00	0.49
36	300053	欧比特	60,000	598,800.00	0.49
37	600483	福能股份	69,100	591,496.00	0.48
38	601929	吉视传媒	242,600	589,518.00	0.48
39	300326	凯利泰	64,400	582,820.00	0.48
40	600020	中原高速	110,700	581,175.00	0.48
41	002400	省广集团	194,800	580,504.00	0.47
42	600269	赣粤高速	130,600	579,864.00	0.47
43	000818	航锦科技	54,300	578,295.00	0.47
44	600502	安徽水利	124,000	576,600.00	0.47
45	300145	中金环境	130,100	564,634.00	0.46
46	600761	安徽合力	58,504	561,638.40	0.46



47	002421	达实智能	150,000	559,500.00	0.46
48	600330	天通股份	71,000	558,060.00	0.46
49	002313	日海智能	27,459	554,671.80	0.45
50	002097	山河智能	86,700	541,008.00	0.44
51	600059	古越龙山	60,600	536,916.00	0.44
52	600577	精达股份	176,300	534,189.00	0.44
53	002430	杭氧股份	44,200	533,052.00	0.44
54	603026	石大胜华	17,600	532,576.00	0.44
55	300349	金卡智能	29,600	526,288.00	0.43
56	002080	中材科技	57,820	523,849.20	0.43
57	600622	光大嘉宝	104,660	509,694.20	0.42
58	600742	一汽富维	47,100	502,557.00	0.41
59	000726	鲁泰 A	52,400	500,944.00	0.41
60	002171	楚江新材	78,400	498,624.00	0.41
61	002091	江苏国泰	87,300	498,483.00	0.41
62	601677	明泰铝业	48,200	496,942.00	0.41
63	600105	永鼎股份	102,600	494,532.00	0.40
64	002222	福晶科技	44,200	493,714.00	0.40
65	000828	东莞控股	53,700	492,429.00	0.40
66	600477	杭萧钢构	150,000	492,000.00	0.40
67	000034	神州数码	38,100	491,490.00	0.40
68	000951	中国重汽	30,600	491,130.00	0.40
69	300102	乾照光电	83,900	489,137.00	0.40
70	002022	科华生物	48,500	485,485.00	0.40
71	603599	广信股份	32,900	482,643.00	0.39
72	600129	太极集团	45,800	482,274.00	0.39
73	002100	天康生物	59,300	480,330.00	0.39
74	002104	恒宝股份	66,600	478,854.00	0.39
75	600496	精工钢构	149,800	474,866.00	0.39
76	000429	粤高速 A	62,400	471,120.00	0.39
77	600285	羚锐制药	55,600	468,708.00	0.38

78	002108	沧州明珠	118,900	463,710.00	0.38
79	002067	景兴纸业	132,800	456,832.00	0.37
80	300458	全志科技	21,800	455,620.00	0.37
81	600420	现代制药	50,800	453,136.00	0.37
82	002258	利尔化学	34,600	451,530.00	0.37
83	300233	金城医药	23,800	450,296.00	0.37
84	000036	华联控股	87,700	448,147.00	0.37
85	600790	轻纺城	123,200	447,216.00	0.37
86	002303	美盈森	92,200	445,326.00	0.36
87	300020	银江股份	55,200	444,912.00	0.36
88	600308	华泰股份	99,400	443,324.00	0.36
89	002267	陕天然气	54,000	442,260.00	0.36
90	000688	国城矿业	41,300	440,258.00	0.36
91	603609	禾丰牧业	37,100	439,264.00	0.36
92	300045	华力创通	49,123	439,159.62	0.36
93	002309	中利集团	63,600	437,568.00	0.36
94	600261	阳光照明	118,600	435,262.00	0.36
95	603118	共进股份	46,900	434,294.00	0.36
96	002228	合兴包装	85,900	432,077.00	0.35
97	300398	飞凯材料	34,700	430,627.00	0.35
98	601908	京运通	121,900	425,431.00	0.35
99	600480	凌云股份	48,500	424,375.00	0.35
100	002135	东南网架	76,500	423,810.00	0.35
101	002055	得润电子	39,200	422,576.00	0.35
102	300031	宝通科技	34,100	421,476.00	0.34
103	300303	聚飞光电	126,200	417,722.00	0.34
104	002298	中电兴发	58,900	417,012.00	0.34
105	600569	安阳钢铁	141,700	413,764.00	0.34
106	002322	理工环科	32,700	411,366.00	0.34
107	600351	亚宝药业	66,700	410,205.00	0.34
108	002277	友阿股份	121,200	409,656.00	0.33

109	000030	富奥股份	87,720	409,652.40	0.33
110	002293	罗莱生活	41,300	409,283.00	0.33
111	002029	七匹狼	63,100	407,626.00	0.33
112	000155	川能动力	95,600	406,300.00	0.33
113	600076	康欣新材	90,100	405,450.00	0.33
114	600681	百川能源	54,400	404,736.00	0.33
115	300219	鸿利智汇	54,000	398,520.00	0.33
116	002619	艾格拉斯	116,200	397,404.00	0.32
117	002308	威创股份	79,700	396,906.00	0.32
118	002283	天润曲轴	100,100	393,393.00	0.32
119	000601	韶能股份	81,500	390,385.00	0.32
120	603337	杰克股份	19,000	389,310.00	0.32
121	002540	亚太科技	81,600	386,784.00	0.32
122	002060	粤水电	119,900	386,078.00	0.32
123	300083	劲胜智能	127,900	382,421.00	0.31
124	000525	红太阳	29,600	382,136.00	0.31
125	601101	昊华能源	61,500	381,915.00	0.31
126	002484	江海股份	62,900	381,174.00	0.31
127	002462	嘉事堂	25,400	381,000.00	0.31
128	603989	艾华集团	20,100	379,488.00	0.31
129	000968	蓝焰控股	32,300	375,003.00	0.31
130	000821	京山轻机	46,200	374,682.00	0.31
131	300309	吉艾科技	56,600	373,560.00	0.31
132	300634	彩讯股份	17,200	372,724.00	0.30
133	002626	金达威	31,800	372,696.00	0.30
134	600211	西藏药业	11,700	370,422.00	0.30
135	600114	东睦股份	58,400	367,336.00	0.30
136	000055	方大集团	71,300	365,056.00	0.30
137	600508	上海能源	37,600	364,344.00	0.30
138	600382	广东明珠	47,100	362,199.00	0.30
139	600995	文山电力	44,700	359,388.00	0.29

140	002668	奥马电器	69,300	358,974.00	0.29
141	000822	山东海化	70,400	357,632.00	0.29
142	002448	中原内配	64,300	357,508.00	0.29
143	603699	纽威股份	29,700	356,400.00	0.29
144	300438	鹏辉能源	22,000	355,960.00	0.29
145	002433	太安堂	70,600	353,706.00	0.29
146	600090	同济堂	75,500	353,340.00	0.29
147	002664	长鹰信质	26,800	350,812.00	0.29
148	600229	城市传媒	46,500	349,215.00	0.29
149	600467	好当家	131,500	348,475.00	0.28
150	603367	辰欣药业	24,000	346,800.00	0.28
151	002650	加加食品	92,100	344,454.00	0.28
152	600738	兰州民百	47,200	342,672.00	0.28
153	603980	吉华集团	37,480	339,568.80	0.28
154	300231	银信科技	47,400	334,644.00	0.27
155	002314	南山控股	110,900	332,700.00	0.27
156	603979	金诚信	39,500	332,590.00	0.27
157	002335	科华恒盛	18,700	330,055.00	0.27
158	300213	佳讯飞鸿	49,100	327,006.00	0.27
159	603298	杭叉集团	25,700	325,362.00	0.27
160	300439	美康生物	21,800	320,678.00	0.26
161	603299	苏盐井神	47,500	320,625.00	0.26
162	002543	万和电气	23,800	319,396.00	0.26
163	300050	世纪鼎利	49,900	316,366.00	0.26
164	002538	司尔特	61,300	315,082.00	0.26
165	300248	新开普	40,300	314,340.00	0.26
166	601599	鹿港文化	100,000	314,000.00	0.26
167	600012	皖通高速	49,500	313,335.00	0.26
168	300114	中航电测	33,500	311,885.00	0.26
169	002822	中装建设	49,600	311,488.00	0.25
170	000631	顺发恒业	102,900	308,700.00	0.25

171	002918	蒙娜丽莎	26,000	304,460.00	0.25
172	601566	九牧王	24,700	304,304.00	0.25
173	600781	辅仁药业	27,200	300,016.00	0.25
174	000561	烽火电子	43,400	299,460.00	0.24
175	002518	科士达	33,400	299,264.00	0.24
176	002101	广东鸿图	39,000	298,350.00	0.24
177	002068	黑猫股份	59,500	296,905.00	0.24
178	002833	弘亚数控	8,100	294,921.00	0.24
179	002502	骅威文化	85,700	294,808.00	0.24
180	002016	世荣兆业	35,900	294,380.00	0.24
181	300252	金信诺	28,100	293,364.00	0.24
182	002685	华东重机	50,000	291,500.00	0.24
183	002033	丽江旅游	48,700	291,226.00	0.24
184	000517	荣安地产	94,700	290,729.00	0.24
185	603898	好莱客	17,500	289,450.00	0.24
186	300485	赛升药业	28,900	286,688.00	0.23
187	002435	长江润发	62,150	284,647.00	0.23
188	600173	卧龙地产	65,000	278,200.00	0.23
189	002852	道道全	19,789	277,639.67	0.23
190	603919	金徽酒	18,000	277,020.00	0.23
191	600618	氯碱化工	34,700	272,742.00	0.22
192	000935	四川双马	16,507	263,946.93	0.22
193	603385	惠达卫浴	29,130	263,626.50	0.22
194	603997	继峰股份	32,100	247,812.00	0.20
195	002287	奇正藏药	8,500	247,010.00	0.20
196	000019	深粮控股	34,200	244,530.00	0.20
197	600381	青海春天	39,600	241,164.00	0.20
198	002577	雷柏科技	22,200	238,650.00	0.20
199	600933	爱柯迪	29,700	233,145.00	0.19
200	603861	白云电器	19,200	192,000.00	0.16
201	000560	我爱我家	39,800	190,244.00	0.16

202	000666	经纬纺机	15,200	189,240.00	0.15
203	000407	胜利股份	48,300	186,921.00	0.15
204	300511	雪榕生物	22,600	181,930.00	0.15
205	600057	厦门象屿	39,800	177,110.00	0.14
206	600708	光明地产	27,600	154,008.00	0.13
207	601126	四方股份	20,400	121,992.00	0.10
208	603308	应流股份	12,000	116,520.00	0.10
209	300194	福安药业	19,000	108,490.00	0.09
210	600997	开滦股份	17,600	107,712.00	0.09
211	000650	仁和药业	10,600	76,426.00	0.06
212	300131	英唐智控	14,100	74,730.00	0.06
213	600054	黄山旅游	2,700	25,083.00	0.02
214	002126	银轮股份	1,600	11,904.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600644	乐山电力	20,000	127,000.00	0.10
2	000032	深桑达 A	12,700	126,111.00	0.10
3	300282	三盛教育	10,000	126,000.00	0.10
4	600163	中闽能源	29,500	124,785.00	0.10
5	601992	金隅集团	33,000	124,080.00	0.10
6	600168	武汉控股	17,000	123,420.00	0.10
7	600683	京投发展	26,200	123,140.00	0.10
8	002403	爱仕达	14,400	122,976.00	0.10
9	000778	新兴铸管	27,600	122,544.00	0.10
10	002454	松芝股份	23,600	122,484.00	0.10

11	300026	红日药业	35,500	122,475.00	0.10
12	002392	北京利尔	34,900	122,150.00	0.10
13	002608	江苏国信	14,300	121,979.00	0.10
14	600580	卧龙电驱	14,500	121,945.00	0.10
15	600488	天药股份	28,600	121,836.00	0.10
16	000919	金陵药业	15,600	121,836.00	0.10
17	603608	天创时尚	16,400	121,688.00	0.10
18	002533	金杯电工	23,700	121,581.00	0.10
19	000786	北新建材	6,700	121,471.00	0.10
20	000952	广济药业	12,200	121,390.00	0.10
21	000966	长源电力	21,400	121,338.00	0.10
22	600328	兰太实业	14,800	121,212.00	0.10
23	002225	濮耐股份	26,400	121,176.00	0.10
24	600479	千金药业	13,000	121,160.00	0.10
25	002743	富煌钢构	19,700	121,155.00	0.10
26	000156	华数传媒	11,000	121,110.00	0.10
27	603766	隆鑫通用	28,900	121,091.00	0.10
28	002173	创新医疗	17,000	121,040.00	0.10
29	002688	金河生物	23,900	120,934.00	0.10
30	300088	长信科技	23,900	120,934.00	0.10
31	603020	爱普股份	14,800	120,916.00	0.10
32	600765	中航重机	13,100	120,913.00	0.10
33	600327	大东方	31,900	120,901.00	0.10
34	600160	巨化股份	17,000	120,870.00	0.10
35	000887	中鼎股份	12,600	120,834.00	0.10
36	000848	承德露露	14,500	120,785.00	0.10
37	600353	旭光股份	22,700	120,764.00	0.10
38	600723	首商股份	17,600	120,736.00	0.10
39	601999	出版传媒	19,600	120,736.00	0.10
40	600629	华建集团	12,500	120,625.00	0.10
41	002144	宏达高科	11,300	120,571.00	0.10

42	002424	贵州百灵	12,200	120,536.00	0.10
43	600073	上海梅林	13,100	120,520.00	0.10
44	600814	杭州解百	22,900	120,454.00	0.10
45	002603	以岭药业	10,400	120,432.00	0.10
46	000685	中山公用	14,100	120,414.00	0.10
47	603100	川仪股份	13,100	120,389.00	0.10
48	002106	莱宝高科	17,100	120,384.00	0.10
49	000529	广弘控股	20,300	120,379.00	0.10
50	000021	深科技	14,800	120,324.00	0.10
51	000999	华润三九	4,100	120,294.00	0.10
52	002092	中泰化学	15,100	120,196.00	0.10
53	600598	北大荒	11,200	120,176.00	0.10
54	603328	依顿电子	11,700	120,159.00	0.10
55	300204	舒泰神	9,700	120,086.00	0.10
56	603037	凯众股份	6,300	119,889.00	0.10
57	002152	广电运通	17,500	119,875.00	0.10
58	601019	山东出版	15,400	119,812.00	0.10
59	600563	法拉电子	2,900	119,393.00	0.10
60	600368	五洲交通	25,500	119,340.00	0.10
61	603016	新宏泰	7,800	119,184.00	0.10
62	002275	桂林三金	8,800	118,712.00	0.10
63	600633	浙数文化	12,670	118,464.50	0.10
64	603306	华懋科技	8,900	117,569.00	0.10
65	002757	南兴股份	6,600	117,282.00	0.10
66	600386	北巴传媒	28,700	116,809.00	0.10
67	000100	TCL 集团	34,800	115,884.00	0.09
68	000423	东阿阿胶	2,900	115,478.00	0.09
69	600704	物产中大	21,300	115,446.00	0.09
70	601098	中南传媒	9,100	115,024.00	0.09
71	603156	养元饮品	3,100	114,948.00	0.09
72	000895	双汇发展	4,600	114,494.00	0.09



73	600566	济川药业	3,800	114,418.00	0.09
74	300132	青松股份	10,500	114,240.00	0.09
75	000899	赣能股份	21,700	114,142.00	0.09
76	601368	绿城水务	18,300	114,009.00	0.09
77	600979	广安爱众	25,300	113,850.00	0.09
78	603188	亚邦股份	14,500	113,825.00	0.09
79	600780	通宝能源	31,600	113,760.00	0.09
80	600757	长江传媒	16,700	113,727.00	0.09
81	600097	开创国际	11,000	113,630.00	0.09
82	300381	溢多利	12,500	113,625.00	0.09
83	600820	隧道股份	18,000	113,580.00	0.09
84	300296	利亚德	14,500	113,535.00	0.09
85	000690	宝新能源	17,600	113,344.00	0.09
86	600056	中国医药	8,400	113,316.00	0.09
87	002128	露天煤业	13,100	113,315.00	0.09
88	600862	中航高科	12,600	113,274.00	0.09
89	603855	华荣股份	12,900	113,262.00	0.09
90	002491	通鼎互联	14,000	113,260.00	0.09
91	000929	兰州黄河	14,200	113,174.00	0.09
92	002632	道明光学	16,400	113,160.00	0.09
93	000090	天健集团	22,900	113,126.00	0.09
94	601567	三星医疗	19,500	113,100.00	0.09
95	002062	宏润建设	29,300	113,098.00	0.09
96	601900	南方传媒	11,900	113,050.00	0.09
97	600713	南京医药	24,900	113,046.00	0.09
98	601996	丰林集团	36,700	113,036.00	0.09
99	600299	安迪苏	10,900	113,033.00	0.09
100	603088	宁波精达	10,800	112,968.00	0.09
101	002111	威海广泰	9,000	112,950.00	0.09
102	000719	中原传媒	15,900	112,890.00	0.09
103	600884	杉杉股份	10,600	112,890.00	0.09

104	002406	远东传动	18,800	112,800.00	0.09
105	300121	阳谷华泰	14,100	112,800.00	0.09
106	002654	万润科技	27,300	112,749.00	0.09
107	002088	鲁阳节能	9,200	112,700.00	0.09
108	000888	峨眉山 A	18,700	112,574.00	0.09
109	000060	中金岭南	24,000	112,560.00	0.09
110	000600	建投能源	16,800	112,560.00	0.09
111	600888	新疆众和	23,008	112,509.12	0.09
112	601997	贵阳银行	13,000	112,450.00	0.09
113	600829	人民同泰	15,900	112,413.00	0.09
114	601801	皖新传媒	18,700	112,387.00	0.09
115	002081	金螳螂	10,900	112,379.00	0.09
116	600594	益佰制药	21,400	112,350.00	0.09
117	600405	动力源	22,500	112,275.00	0.09
118	603633	徕木股份	9,700	112,229.00	0.09
119	601928	凤凰传媒	13,900	112,173.00	0.09
120	002013	中航机电	16,300	112,144.00	0.09
121	600499	科达洁能	25,600	112,128.00	0.09
122	002724	海洋王	19,200	112,128.00	0.09
123	601138	工业富联	9,300	112,065.00	0.09
124	600978	宜华生活	29,800	112,048.00	0.09
125	002195	二三四五	28,800	112,032.00	0.09
126	300182	捷成股份	25,400	112,014.00	0.09
127	600522	中天科技	12,200	111,874.00	0.09
128	000547	航天发展	11,700	111,852.00	0.09
129	002065	东华软件	16,000	111,840.00	0.09
130	600373	中文传媒	8,900	111,784.00	0.09
131	002546	新联电子	24,400	111,752.00	0.09
132	603669	灵康药业	14,900	111,750.00	0.09
133	603528	多伦科技	14,900	111,750.00	0.09
134	300150	世纪瑞尔	24,500	111,720.00	0.09

135	603025	大豪科技	10,900	111,616.00	0.09
136	603566	普莱柯	9,200	111,504.00	0.09
137	000997	新大陆	6,600	111,474.00	0.09
138	000623	吉林敖东	6,800	111,452.00	0.09
139	600189	吉林森工	26,100	111,447.00	0.09
140	601616	广电电气	31,300	111,428.00	0.09
141	002160	常铝股份	31,200	111,384.00	0.09
142	002026	山东威达	19,200	111,360.00	0.09
143	603788	宁波高发	8,200	111,356.00	0.09
144	002620	瑞和股份	17,800	111,250.00	0.09
145	300287	飞利信	28,000	111,160.00	0.09
146	603869	新智认知	6,100	111,020.00	0.09
147	600482	中国动力	4,700	111,014.00	0.09
148	002527	新时达	20,900	110,979.00	0.09
149	002790	瑞尔特	16,400	110,864.00	0.09
150	600551	时代出版	12,200	110,654.00	0.09
151	600804	鹏博士	14,700	110,544.00	0.09
152	600410	华胜天成	10,300	110,519.00	0.09
153	002286	保龄宝	18,700	110,517.00	0.09
154	600100	同方股份	12,200	110,410.00	0.09
155	300297	蓝盾股份	18,300	110,349.00	0.09
156	300360	炬华科技	13,500	110,295.00	0.09
157	300459	金科文化	19,300	109,817.00	0.09
158	600510	黑牡丹	17,000	107,440.00	0.09
159	002174	游族网络	5,700	96,216.00	0.08
160	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.07
161	600968	海油发展	22,483	79,814.65	0.07
162	603878	武进不锈	7,400	79,550.00	0.07
163	603518	锦泓集团	7,800	71,994.00	0.06
164	600727	鲁北化工	10,000	66,600.00	0.05
165	601198	东兴证券	4,800	57,024.00	0.05

166	600881	亚泰集团	15,200	49,400.00	0.04
167	601009	南京银行	4,800	39,648.00	0.03
168	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
169	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
170	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.03
171	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
172	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02
173	603863	松炆资源	935	21,579.80	0.02
174	601139	深圳燃气	2,100	11,949.00	0.01
175	002559	亚威股份	900	4,905.00	-

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600728	佳都科技	2,168,612.82	4.95
2	603368	柳药股份	2,139,255.80	4.88
3	300271	华宇软件	2,019,358.00	4.61
4	600477	杭萧钢构	1,916,807.71	4.37
5	601929	吉视传媒	1,803,242.00	4.11
6	000560	我爱我家	1,753,773.10	4.00
7	601588	北辰实业	1,723,073.00	3.93
8	600602	云赛智联	1,711,144.00	3.90
9	000739	普洛药业	1,696,016.63	3.87
10	600330	天通股份	1,678,875.00	3.83
11	002258	利尔化学	1,678,119.00	3.83
12	002430	杭氧股份	1,669,740.00	3.81
13	000429	粤高速 A	1,666,387.00	3.80
14	300098	高新兴	1,660,386.00	3.79
15	600675	中华企业	1,636,937.00	3.73

16	002746	仙坛股份	1,635,269.60	3.73
17	002413	雷科防务	1,590,590.13	3.63
18	002675	东诚药业	1,561,818.00	3.56
19	600641	万业企业	1,553,887.00	3.54
20	600337	美克家居	1,541,565.00	3.52
21	600123	兰花科创	1,539,687.00	3.51
22	002396	星网锐捷	1,520,453.00	3.47
23	600020	中原高速	1,517,026.34	3.46
24	002262	恩华药业	1,506,900.00	3.44
25	000875	吉电股份	1,501,293.00	3.42
26	002313	日海智能	1,492,220.80	3.40
27	002157	正邦科技	1,474,602.00	3.36
28	000059	华锦股份	1,465,764.00	3.34
29	002531	天顺风能	1,459,401.00	3.33
30	000818	航锦科技	1,458,420.00	3.33
31	600803	新奥股份	1,453,281.00	3.31
32	600577	精达股份	1,449,950.00	3.31
33	300053	欧比特	1,435,306.00	3.27
34	300145	中金环境	1,434,244.00	3.27
35	600850	华东电脑	1,422,766.00	3.24
36	000951	中国重汽	1,420,017.59	3.24
37	601139	深圳燃气	1,410,694.00	3.22
38	300248	新开普	1,409,091.00	3.21
39	000155	川能动力	1,395,575.00	3.18
40	300045	华力创通	1,381,644.93	3.15
41	300377	赢时胜	1,379,327.00	3.15
42	002467	二六三	1,375,284.00	3.14
43	300263	隆华科技	1,374,245.00	3.13
44	600114	东睦股份	1,364,662.04	3.11
45	002126	银轮股份	1,363,708.00	3.11
46	002091	江苏国泰	1,360,383.85	3.10

47	600596	新安股份	1,357,294.00	3.10
48	600057	厦门象屿	1,356,661.32	3.09
49	000683	远兴能源	1,354,363.00	3.09
50	600873	梅花生物	1,341,660.00	3.06
51	002067	景兴纸业	1,340,317.00	3.06
52	300149	量子生物	1,338,855.00	3.05
53	603609	禾丰牧业	1,333,324.00	3.04
54	600185	格力地产	1,331,748.66	3.04
55	000301	东方盛虹	1,324,519.00	3.02
56	000977	浪潮信息	1,310,779.60	2.99
57	000921	海信家电	1,303,988.99	2.97
58	300102	乾照光电	1,301,850.00	2.97
59	300458	全志科技	1,296,503.00	2.96
60	000902	新洋丰	1,293,883.00	2.95
61	300300	汉鼎宇佑	1,290,826.00	2.94
62	300232	洲明科技	1,284,270.80	2.93
63	300349	金卡智能	1,283,553.00	2.93
64	002139	拓邦股份	1,283,457.00	2.93
65	600622	光大嘉宝	1,282,902.00	2.93
66	600106	重庆路桥	1,282,889.28	2.93
67	002421	达实智能	1,278,257.00	2.92
68	002168	惠程科技	1,273,630.00	2.90
69	600211	西藏药业	1,268,668.00	2.89
70	000933	神火股份	1,268,592.00	2.89
71	300233	金城医药	1,267,464.00	2.89
72	600076	康欣新材	1,266,060.00	2.89
73	002138	顺络电子	1,265,108.00	2.89
74	601101	昊华能源	1,261,186.00	2.88
75	603678	火炬电子	1,260,073.00	2.87
76	002029	七匹狼	1,258,296.00	2.87
77	300213	佳讯飞鸿	1,255,225.00	2.86

78	002419	天虹股份	1,255,072.00	2.86
79	300014	亿纬锂能	1,254,005.00	2.86
80	600105	永鼎股份	1,248,617.00	2.85
81	603039	泛微网络	1,242,280.96	2.83
82	300502	新易盛	1,233,911.00	2.81
83	000797	中国武夷	1,232,698.00	2.81
84	002597	金禾实业	1,231,753.00	2.81
85	600745	闻泰科技	1,217,333.00	2.78
86	600323	瀚蓝环境	1,211,993.00	2.76
87	603108	润达医疗	1,209,005.46	2.76
88	002203	海亮股份	1,208,343.29	2.76
89	600997	开滦股份	1,206,057.00	2.75
90	300118	东方日升	1,203,864.00	2.75
91	300292	吴通控股	1,201,356.00	2.74
92	002293	罗莱生活	1,196,874.00	2.73
93	002206	海利得	1,195,023.00	2.73
94	002135	东南网架	1,193,009.00	2.72
95	603393	新天然气	1,188,363.34	2.71
96	600711	盛屯矿业	1,187,341.00	2.71
97	002020	京新药业	1,187,337.00	2.71
98	002104	恒宝股份	1,185,695.00	2.70
99	002222	福晶科技	1,179,746.00	2.69
100	603456	九洲药业	1,176,212.40	2.68
101	601666	平煤股份	1,175,694.37	2.68
102	300203	聚光科技	1,173,043.00	2.68
103	600093	易见股份	1,172,086.00	2.67
104	000407	胜利股份	1,170,749.00	2.67
105	300365	恒华科技	1,166,597.00	2.66
106	600483	福能股份	1,163,381.00	2.65
107	603308	应流股份	1,162,840.13	2.65
108	300038	数知科技	1,154,765.40	2.63

109	002130	沃尔核材	1,154,334.00	2.63
110	000968	蓝焰控股	1,152,677.00	2.63
111	000821	京山轻机	1,151,541.00	2.63
112	002327	富安娜	1,148,514.00	2.62
113	600261	阳光照明	1,141,791.00	2.60
114	000672	上峰水泥	1,134,850.00	2.59
115	600601	方正科技	1,133,412.00	2.58
116	601058	赛轮轮胎	1,132,024.00	2.58
117	300326	凯利泰	1,130,888.00	2.58
118	300379	东方通	1,126,439.05	2.57
119	002267	陕天然气	1,126,301.00	2.57
120	600285	羚锐制药	1,123,102.00	2.56
121	600252	中恒集团	1,120,136.00	2.55
122	603730	岱美股份	1,118,312.00	2.55
123	600569	安阳钢铁	1,116,536.00	2.55
124	300130	新国都	1,115,742.18	2.54
125	300398	飞凯材料	1,107,246.00	2.53
126	600684	珠江实业	1,105,719.00	2.52
127	603599	广信股份	1,102,266.00	2.51
128	000591	太阳能	1,101,864.00	2.51
129	002458	益生股份	1,093,455.00	2.49
130	002322	理工环科	1,091,269.00	2.49
131	002099	海翔药业	1,085,183.00	2.47
132	600590	泰豪科技	1,084,690.00	2.47
133	002698	博实股份	1,083,357.88	2.47
134	600986	科达股份	1,083,351.00	2.47
135	002335	科华恒盛	1,081,491.00	2.47
136	002060	粤水电	1,080,178.00	2.46
137	600681	百川能源	1,078,884.00	2.46
138	000055	方大集团	1,078,049.00	2.46
139	000498	山东路桥	1,077,795.00	2.46



140	600708	光明地产	1,076,305.40	2.45
141	002643	万润股份	1,075,649.00	2.45
142	002080	中材科技	1,068,889.00	2.44
143	300366	创意信息	1,067,839.00	2.44
144	002822	中装建设	1,067,619.00	2.43
145	002301	齐心集团	1,067,256.00	2.43
146	000666	经纬纺机	1,066,918.00	2.43
147	300355	蒙草生态	1,064,724.00	2.43
148	000035	中国天楹	1,064,724.00	2.43
149	600110	诺德股份	1,062,485.22	2.42
150	002568	百润股份	1,062,467.00	2.42
151	300050	世纪鼎利	1,057,994.00	2.41
152	600059	古越龙山	1,057,556.00	2.41
153	300226	上海钢联	1,056,868.00	2.41
154	600308	华泰股份	1,055,886.00	2.41
155	002033	丽江旅游	1,054,962.00	2.41
156	600761	安徽合力	1,054,327.60	2.40
157	601566	九牧王	1,051,341.00	2.40
158	002171	楚江新材	1,049,370.00	2.39
159	601799	星宇股份	1,048,002.80	2.39
160	002425	凯撒文化	1,047,178.00	2.39
161	300131	英唐智控	1,046,550.92	2.39
162	601388	怡球资源	1,046,336.00	2.39
163	300367	东方网力	1,046,087.00	2.39
164	002145	中核钛白	1,046,019.00	2.39
165	002298	中电兴发	1,042,787.00	2.38
166	000710	贝瑞基因	1,042,568.26	2.38
167	300424	航新科技	1,041,889.00	2.38
168	002389	航天彩虹	1,037,616.00	2.37
169	600502	安徽水利	1,037,374.40	2.37
170	002215	诺普信	1,036,594.00	2.36

171	000811	冰轮环境	1,035,742.48	2.36
172	603338	浙江鼎力	1,033,650.50	2.36
173	300567	精测电子	1,032,596.50	2.35
174	300205	天喻信息	1,030,321.00	2.35
175	600512	腾达建设	1,030,284.00	2.35
176	601126	四方股份	1,026,140.00	2.34
177	000915	山大华特	1,024,985.00	2.34
178	002833	弘亚数控	1,016,148.00	2.32
179	300047	天源迪科	1,013,783.00	2.31
180	300185	通裕重工	1,005,748.00	2.29
181	002117	东港股份	1,004,090.00	2.29
182	601918	新集能源	996,667.00	2.27
183	000584	哈工智能	986,255.00	2.25
184	000910	大亚圣象	983,684.00	2.24
185	300735	光弘科技	978,278.00	2.23
186	600210	紫江企业	977,898.00	2.23
187	000030	富奥股份	976,066.80	2.23
188	002234	民和股份	975,444.00	2.22
189	002449	国星光电	973,029.65	2.22
190	002035	华帝股份	971,780.38	2.22
191	600067	冠城大通	971,579.00	2.22
192	300252	金信诺	969,159.00	2.21
193	002543	万和电气	969,143.00	2.21
194	300311	任子行	965,674.00	2.20
195	601375	中原证券	965,243.00	2.20
196	002261	拓维信息	962,510.00	2.20
197	600363	联创光电	959,980.00	2.19
198	300137	先河环保	959,021.00	2.19
199	002314	南山控股	958,706.00	2.19
200	300207	欣旺达	958,422.00	2.19
201	002376	新北洋	957,884.00	2.18

202	000550	江铃汽车	957,201.00	2.18
203	000828	东莞控股	957,188.00	2.18
204	300276	三丰智能	949,189.80	2.16
205	002036	联创电子	948,272.00	2.16
206	000883	湖北能源	948,028.00	2.16
207	603636	南威软件	948,024.71	2.16
208	002031	巨轮智能	946,889.00	2.16
209	000525	红太阳	941,436.00	2.15
210	002756	永兴特钢	940,731.00	2.15
211	300628	亿联网络	938,459.00	2.14
212	600676	交运股份	937,974.00	2.14
213	300440	运达科技	936,536.90	2.14
214	603517	绝味食品	935,600.29	2.13
215	000036	华联控股	935,239.00	2.13
216	603660	苏州科达	928,849.20	2.12
217	000049	德赛电池	920,543.00	2.10
218	600456	宝钛股份	919,898.00	2.10
219	002246	北化股份	919,669.00	2.10
220	603980	吉华集团	918,152.00	2.09
221	300065	海兰信	917,293.00	2.09
222	603898	好莱客	917,229.00	2.09
223	002537	海联金汇	908,300.00	2.07
224	002648	卫星石化	903,326.00	2.06
225	300031	宝通科技	901,783.00	2.06
226	600197	伊力特	901,436.98	2.06
227	603399	吉翔股份	896,217.00	2.04
228	002185	华天科技	894,587.00	2.04
229	601908	京运通	893,802.00	2.04
230	002550	千红制药	893,442.00	2.04
231	600661	昂立教育	892,893.00	2.04
232	600797	浙大网新	886,380.00	2.02

233	000935	四川双马	884,495.90	2.02
234	300309	吉艾科技	883,235.00	2.01
235	300078	思创医惠	882,155.00	2.01
236	002664	长鹰信质	880,685.00	2.01
237	300511	雪榕生物	878,710.00	2.00
238	002918	蒙娜丽莎	878,285.00	2.00
239	300523	辰安科技	877,854.00	2.00
240	002182	云海金属	877,854.00	2.00
241	600995	文山电力	876,992.00	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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300271	华宇软件	2,195,498.00	5.01
2	000739	普洛药业	1,761,684.00	4.02
3	002396	星网锐捷	1,730,851.00	3.95
4	002157	正邦科技	1,730,414.00	3.95
5	002746	仙坛股份	1,707,828.27	3.89
6	600641	万业企业	1,686,359.00	3.85
7	603368	柳药股份	1,618,361.52	3.69
8	002262	恩华药业	1,612,299.70	3.68
9	002531	天顺风能	1,605,138.00	3.66
10	600803	新奥股份	1,594,060.00	3.64
11	000560	我爱我家	1,581,496.40	3.61
12	000977	浪潮信息	1,572,120.00	3.59
13	002126	银轮股份	1,479,332.00	3.37
14	600477	杭萧钢构	1,469,664.80	3.35
15	002139	拓邦股份	1,443,140.50	3.29
16	000902	新洋丰	1,442,605.00	3.29

17	000301	东方盛虹	1,425,804.00	3.25
18	300377	赢时胜	1,418,148.00	3.23
19	600745	闻泰科技	1,417,433.00	3.23
20	002138	顺络电子	1,414,577.00	3.23
21	600596	新安股份	1,409,465.92	3.21
22	002419	天虹股份	1,406,330.00	3.21
23	601139	深圳燃气	1,388,803.00	3.17
24	300263	隆华科技	1,386,445.00	3.16
25	002020	京新药业	1,377,076.00	3.14
26	600323	瀚蓝环境	1,364,112.00	3.11
27	300014	亿纬锂能	1,359,361.00	3.10
28	603108	润达医疗	1,349,564.82	3.08
29	603678	火炬电子	1,343,443.00	3.06
30	300232	洲明科技	1,342,423.99	3.06
31	300149	量子生物	1,325,480.00	3.02
32	600330	天通股份	1,306,596.00	2.98
33	600106	重庆路桥	1,291,125.20	2.94
34	002168	惠程科技	1,288,117.00	2.94
35	300300	汉鼎宇佑	1,286,861.14	2.93
36	600711	盛屯矿业	1,278,534.00	2.92
37	000797	中国武夷	1,276,270.98	2.91
38	002206	海利得	1,272,812.00	2.90
39	603393	新天然气	1,271,216.00	2.90
40	000933	神火股份	1,268,720.00	2.89
41	600057	厦门象屿	1,265,306.00	2.89
42	601666	平煤股份	1,261,945.40	2.88
43	300130	新国都	1,253,437.00	2.86
44	000672	上峰水泥	1,251,658.79	2.85
45	002258	利尔化学	1,251,157.00	2.85
46	600728	佳都科技	1,249,920.77	2.85
47	601929	吉视传媒	1,246,187.00	2.84

48	002130	沃尔核材	1,245,425.00	2.84
49	603039	泛微网络	1,244,997.96	2.84
50	300203	聚光科技	1,239,748.00	2.83
51	002327	富安娜	1,225,818.00	2.80
52	600590	泰豪科技	1,220,693.00	2.78
53	002430	杭氧股份	1,220,096.00	2.78
54	300292	吴通控股	1,216,045.00	2.77
55	300365	恒华科技	1,209,388.50	2.76
56	600602	云赛智联	1,195,330.00	2.73
57	300502	新易盛	1,194,112.00	2.72
58	002698	博实股份	1,193,701.50	2.72
59	600093	易见股份	1,193,490.00	2.72
60	601588	北辰实业	1,191,888.00	2.72
61	603456	九洲药业	1,188,583.00	2.71
62	601799	星宇股份	1,181,544.00	2.69
63	002568	百润股份	1,171,086.00	2.67
64	000429	粤高速 A	1,158,229.00	2.64
65	300226	上海钢联	1,154,378.00	2.63
66	300366	创意信息	1,150,160.00	2.62
67	600997	开滦股份	1,142,209.00	2.60
68	300379	东方通	1,140,169.00	2.60
69	000883	湖北能源	1,135,680.35	2.59
70	300047	天源迪科	1,135,408.80	2.59
71	600708	光明地产	1,133,198.15	2.58
72	300355	蒙草生态	1,128,407.00	2.57
73	603730	岱美股份	1,127,290.78	2.57
74	002145	中核钛白	1,124,889.00	2.57
75	600512	腾达建设	1,116,537.00	2.55
76	300207	欣旺达	1,111,087.00	2.53
77	300205	天喻信息	1,110,886.79	2.53
78	600986	科达股份	1,109,194.00	2.53

79	002458	益生股份	1,103,247.80	2.52
80	002301	齐心集团	1,098,811.00	2.51
81	300185	通裕重工	1,098,561.00	2.51
82	603517	绝味食品	1,091,236.60	2.49
83	600684	珠江实业	1,088,578.00	2.48
84	603338	浙江鼎力	1,088,173.18	2.48
85	002425	凯撒文化	1,087,950.00	2.48
86	000035	中国天楹	1,084,548.00	2.47
87	600845	宝信软件	1,082,237.00	2.47
88	002117	东港股份	1,081,949.50	2.47
89	002215	诺普信	1,079,162.00	2.46
90	600067	冠城大通	1,077,067.00	2.46
91	000811	冰轮环境	1,075,259.52	2.45
92	300248	新开普	1,072,785.00	2.45
93	000498	山东路桥	1,065,471.00	2.43
94	603308	应流股份	1,064,147.00	2.43
95	600114	东睦股份	1,062,983.54	2.42
96	000910	大亚圣象	1,060,272.00	2.42
97	000710	贝瑞基因	1,059,635.00	2.42
98	600337	美克家居	1,054,073.04	2.40
99	600363	联创光电	1,049,377.00	2.39
100	600577	精达股份	1,048,555.00	2.39
101	600797	浙大网新	1,047,667.00	2.39
102	300276	三丰智能	1,047,063.00	2.39
103	300424	航新科技	1,043,747.00	2.38
104	300628	亿联网络	1,042,750.00	2.38
105	601388	怡球资源	1,041,821.00	2.38
106	300567	精测电子	1,039,098.00	2.37
107	300367	东方网力	1,038,541.00	2.37
108	600676	交运股份	1,036,961.00	2.36
109	601126	四方股份	1,036,438.00	2.36

110	600123	兰花科创	1,033,755.00	2.36
111	300311	任子行	1,032,396.06	2.35
112	000584	哈工智能	1,027,976.00	2.34
113	603636	南威软件	1,022,746.00	2.33
114	002756	永兴特钢	1,021,788.00	2.33
115	300145	中金环境	1,020,380.00	2.33
116	000915	山大华特	1,016,082.00	2.32
117	002031	巨轮智能	1,015,629.00	2.32
118	000155	川能动力	1,015,083.00	2.32
119	002389	航天彩虹	1,014,424.00	2.31
120	002550	千红制药	1,012,534.00	2.31
121	300045	华力创通	1,011,361.00	2.31
122	002036	联创电子	1,003,991.00	2.29
123	002246	北化股份	1,002,585.00	2.29
124	601918	新集能源	997,073.00	2.27
125	002648	卫星石化	996,970.00	2.27
126	300735	光弘科技	994,225.60	2.27
127	300065	海兰信	994,122.00	2.27
128	000550	江铃汽车	991,905.00	2.26
129	002035	华帝股份	991,857.00	2.26
130	600210	紫江企业	990,986.12	2.26
131	002675	东诚药业	989,723.00	2.26
132	002261	拓维信息	988,797.00	2.26
133	002481	双塔食品	987,106.00	2.25
134	601375	中原证券	986,451.00	2.25
135	000951	中国重汽	981,753.90	2.24
136	000407	胜利股份	981,189.00	2.24
137	600456	宝钛股份	979,796.00	2.23
138	600211	西藏药业	977,604.00	2.23
139	603609	禾丰牧业	977,007.00	2.23
140	600020	中原高速	976,391.67	2.23



141	600720	祁连山	975,992.00	2.23
142	601101	昊华能源	975,851.00	2.23
143	000875	吉电股份	975,760.00	2.23
144	002234	民和股份	971,742.00	2.22
145	002185	华天科技	971,567.00	2.22
146	002649	博彦科技	969,415.00	2.21
147	300339	润和软件	965,985.00	2.20
148	300131	英唐智控	965,841.00	2.20
149	002182	云海金属	964,347.57	2.20
150	600486	扬农化工	963,578.90	2.20
151	300523	辰安科技	962,028.00	2.19
152	002240	威华股份	960,537.98	2.19
153	300440	运达科技	958,672.00	2.19
154	000666	经纬纺机	955,866.00	2.18
155	000818	航锦科技	953,948.00	2.18
156	300137	先河环保	952,173.00	2.17
157	300463	迈克生物	948,677.00	2.16
158	600661	昂立教育	947,062.98	2.16
159	300237	美晨生态	945,991.00	2.16
160	002821	凯莱英	942,804.59	2.15
161	000546	金圆股份	940,475.00	2.14
162	300213	佳讯飞鸿	939,649.00	2.14
163	000049	德赛电池	939,345.64	2.14
164	000043	中航善达	937,968.00	2.14
165	603277	银都股份	934,465.00	2.13
166	300036	超图软件	933,865.00	2.13
167	600562	国睿科技	929,492.00	2.12
168	000967	盈峰环境	927,425.00	2.12
169	603399	吉翔股份	926,899.00	2.11
170	300476	胜宏科技	921,573.80	2.10
171	600063	皖维高新	919,382.00	2.10

172	000059	华锦股份	917,379.00	2.09
173	300078	思创医惠	915,824.00	2.09
174	002235	安妮股份	914,825.00	2.09
175	300323	华灿光电	914,299.00	2.09
176	002383	合众思壮	911,472.00	2.08
177	002313	日海智能	910,038.00	2.08
178	300233	金城医药	909,085.00	2.07
179	600707	彩虹股份	906,116.00	2.07
180	300304	云意电气	904,243.00	2.06
181	002382	蓝帆医疗	903,266.00	2.06
182	002705	新宝股份	902,720.00	2.06
183	603939	益丰药房	899,176.14	2.05
184	600771	广誉远	889,897.60	2.03
185	002067	景兴纸业	889,823.00	2.03
186	600702	舍得酒业	889,614.00	2.03
187	002537	海联金汇	888,946.00	2.03
188	600197	伊力特	888,271.00	2.03
189	300021	大禹节水	888,058.00	2.03
190	002091	江苏国泰	887,997.00	2.03
191	600686	金龙汽车	887,377.00	2.02
192	600855	航天长峰	883,669.00	2.02
193	002867	周大生	882,141.86	2.01
194	603508	思维列控	881,315.22	2.01
195	002025	航天电器	881,244.00	2.01
196	603612	索通发展	881,195.80	2.01
197	300285	国瓷材料	880,297.00	2.01
198	300073	当升科技	878,155.00	2.00

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	871,730,677.20
卖出股票收入（成交）总额	811,523,531.90

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,358,912.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,802,880.00	3.93
	其中：政策性金融债	4,802,880.00	3.93
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)	21,200.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,182,992.00	5.06

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	48,000	4,802,880.00	3.93
2	019611	19国债01	13,600	1,358,912.00	1.11
3	128068	和而转债	212	21,200.00	0.02

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1907	IC1907	3	2,943,840.00	40,400.00	-
公允价值变动总额合计(元)					40,400.00
股指期货投资本期收益(元)					-129,806.60
股指期货投资本期公允价值变动(元)					40,400.00

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本年度进行了少量的多头套保。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 本报告期内，未出现基金投资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。

7.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	401,602.89
2	应收证券清算款	2,703,735.44
3	应收股利	-
4	应收利息	136,379.68
5	应收申购款	840,582.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,082,300.97

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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

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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 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1 000增	1,87 2	28,350.22	5,000,166.70	9.42%	48,071,445.02	90.58%

强A						
创金合信中证1000增强C	1,157	66,945.10	52,615,776.36	67.93%	24,839,706.87	32.07%
合计	2,962	44,067.22	57,615,943.06	44.14%	72,911,151.89	55.86%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证1000增强A	98,288.58	0.19%
	创金合信中证1000增强C	59,562.11	0.08%
	合计	157,850.69	0.12%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证1000增强A	0~10
	创金合信中证1000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1000增强A	0
	创金合信中证1000增强C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发 起 份 额 承 诺 持 有 期 限
基金管理人固有资金	10,000,333.36	7.66%	10,000,333.36	7.66%	36月
基金管理人高级管理人员	32,808.17	0.03%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	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	10,033,141.53	7.69%	10,000,333.36	7.66%	36月

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证1000增强 A	创金合信中证1000增强 C
基金合同生效日(2016年12月22日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	27,019,851.67	31,914,948.65
本报告期基金总申购份额	63,049,192.06	90,391,467.01
减：本报告期基金总赎回份额	36,997,432.01	44,850,932.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,071,611.72	77,455,483.23

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2019年6月12日起，张雪松先生不再担任创金合信基金管理有限公司副总经理。

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金元证券	2	481,155,201.75	28.61%	105,490.14	17.34%	-



第一创业证券	2	1,200,774,342.20	71.39%	502,918.10	82.66%	-
--------	---	------------------	--------	------------	--------	---

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。

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金元证券	6,541,177.50	58.46%	13,900,000.00	63.47%	-	-	-	-
第一创业证券	4,647,324.30	41.54%	8,000,000.00	36.53%	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	公司官网、上海证券报	2019-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金增加华泰证券为代销机构的	公司官网、上海证券报	2019-01-22

	公告暨参加华泰证券费率优惠活动的公告		
3	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2018年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报	2019-02-01
4	创金合信中证1000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2号）	公司官网、上海证券报	2019-02-01
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与中投证券费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报	2019-03-28
6	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告	公司官网	2019-03-29
7	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	公司官网、上海证券报	2019-03-29
8	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、上海证券报	2019-04-04
9	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、上海证券报	2019-04-08
10	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年第一季度报告	公司官网、上海证券报	2019-04-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	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	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别	号	份额比例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20190304 - 20190630	0.00	44,752,741.11	0.00	44,752,741.11	34.29%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证1000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1000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1000指数增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十七日

