

创金合信国证 2000 指数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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61

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	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信国证2000指数	
基金主代码	005565	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,365,574.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
下属分级基金的交易代码	005565	005566
报告期末下属分级基金的份额总额	5,521,471.54份	5,844,102.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。
业绩比较基准	国证2000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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A栋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	证券时报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	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》、《上海证券报》变更为《证券时报》。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
本期已实现收益	401,284.47	443,629.82
本期利润	927,726.74	1,145,039.32
加权平均基金份额本期利润	0.1731	0.1885
本期加权平均净值利润率	18.63%	20.44%
本期基金份额净值增长率	24.16%	24.17%
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	-385,111.74	-415,866.71
期末可供分配基金份额利润	-0.0697	-0.0712
期末基金资产净值	5,193,450.03	5,487,906.86
期末基金份额净值	0.9406	0.9391
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	-5.94%	-6.09%

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

创金合信国证2000指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.25%	1.47%	-0.76%	1.46%	1.01%	0.01%
过去三个月	-7.45%	1.84%	-8.99%	1.84%	1.54%	0.00%
过去六个月	24.16%	1.78%	19.27%	1.78%	4.89%	0.00%
过去一年	1.61%	1.65%	-1.23%	1.64%	2.84%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-5.94%	1.57%	-7.69%	1.57%	1.75%	0.00%

创金合信国证2000指数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	0.23%	1.47%	-0.76%	1.46%	0.99%	0.01%
过去三个月	-7.43%	1.84%	-8.99%	1.84%	1.56%	0.00%
过去六个月	24.17%	1.78%	19.27%	1.78%	4.90%	0.00%
过去一年	1.55%	1.65%	-1.23%	1.64%	2.78%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-6.09%	1.57%	-7.69%	1.57%	1.60%	0.00%

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



注：本基金的合同生效日为2018年2月7日，本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	11年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UC LA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任指数

					策略投资研究部副总监、 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为国证2000指数，业绩基准为国证2000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。国证2000指数的样本股由：在深圳、上海证券交易所上市的除ST、*ST股票外，按照市值和成交金额在市场中所占比例的综合排名，扣除国证1000指数样本股后，排名靠前的2000只股票构成。该指数于2014年3月28日发布，用以反映A股市场小盘股票的价格变动趋势。本基金的投资策略，正常情况下，主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形

导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证2000指数A基金份额净值为0.9406元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为24.16%，同期业绩比较基准收益率为19.27%；截至报告期末创金合信国证2000指数C基金份额净值为0.9391元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为24.17%，同期业绩比较基准收益率为19.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期中美贸易谈判重启，摩擦有所缓和，但中美合作有限、竞争加剧的态势将长期存在。短期给出口部门和企业带来下行压力，但长期给国内经济转型升级带来动力；科创板加速落地，带动部分基础性制度革新，利好资本市场长远发展；经过二季度回调，A股整体估值处于中低位水平，具备长期投资价值。

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

托管人声明，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合规守信、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。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信国证2000指数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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	343,076.49	296,036.24
结算备付金		11,744.14	3,035.94
存出保证金		1,484.19	1,128.54
交易性金融资产	6.4.7.2	10,359,520.23	8,701,321.40
其中：股票投资		10,039,328.23	8,400,001.40
基金投资		-	-
债券投资		320,192.00	301,320.00
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		-	55,035.83
应收利息	6.4.7.5	8,118.83	8,453.77
应收股利		-	-
应收申购款		1,076.40	9,125.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,725,020.28	9,074,136.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	71,750.98
应付赎回款		7,280.01	4,747.29
应付管理人报酬		4,351.94	3,942.06
应付托管费		870.39	788.41
应付销售服务费		900.91	879.63
应付交易费用	6.4.7.7	7,383.48	3,261.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	22,876.66	123,000.01
负债合计		43,663.39	208,370.04
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	11,365,574.29	11,713,349.42
未分配利润	6.4.7.10	-684,217.40	-2,847,582.74
所有者权益合计		10,681,356.89	8,865,766.68
负债和所有者权益总		10,725,020.28	9,074,136.72

计			
---	--	--	--

注：1. 报告截止日2019年6月30日，基金份额总额11,365,574.29份，其中下属A类基金份额5,521,471.54份，C类基金份额5,844,102.75份。下属A类基金份额净值0.9406元，C类基金份额净值0.9391元。

2. 本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：创金合信国证2000指数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02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入		2,163,838.30	-743,858.05
1. 利息收入		6,515.51	7,082.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,278.94	4,435.59
债券利息收入		5,236.57	2,646.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		920,180.17	238,696.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	835,523.70	170,989.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-994.51	-278.80
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	-	-

股利收益	6.4.7.15	85,650.98	67,986.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,227,851.77	-996,350.67
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	9,290.85	6,713.69
减：二、费用		91,072.24	114,444.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,077.24	21,712.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,215.47	4,342.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,525.68	4,426.28
4. 交易费用	6.4.7.18	22,777.46	20,069.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	31,476.39	63,893.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,072,766.06	-858,302.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,072,766.06	-858,302.41

注：本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信国证2000指数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)	11,713,349.42	-2,847,582.74	8,865,766.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,072,766.06	2,072,766.06
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)	-347,775.13	90,599.28	-257,175.85
其中：1. 基金申购款	2,904,915.90	-69,805.29	2,835,110.61
2. 基金赎回款	-3,252,691.03	160,404.57	-3,092,286.46
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)	11,365,574.29	-684,217.40	10,681,356.89
项 目	上年度可比期间 2018年02月07日(基金合同生效日)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)	10,057,640.00	-	10,057,640.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-858,302.41	-858,302.41
三、本期基金份额交易产生的基金净	750,267.74	50,129.51	800,397.25

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	2,196,863.20	105,489.00	2,302,352.20
2. 基金赎回款	-1,446,595.46	-55,359.49	-1,501,954.95
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）	10,807,907.74	-808,172.90	9,999,734.84

注：本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

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

创金合信国证2000指数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[2017]2452号《关于准予创金合信国证2000指数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《创金合信国证2000指数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10,057,233.57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(2018)第0028号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,057,640.00份基金份额,其中认购资金利息折合406.43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10,000,400.04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《创金合信国证2000指数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《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成分股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为：国证2000指数收益率×95% + 银行人民币活期存款利率（税后）×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》、《创金合信国证2000指数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。

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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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	343,076.49
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	343,076.49

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		9,870,915.23	10,039,328.23	168,413.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	320,956.80	320,192.00	-764.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	320,956.80	320,192.00	-764.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,191,872.03	10,359,520.23	167,648.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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	64.71
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	5.20
应收债券利息	8,048.22
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	0.70
合计	8,118.83

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	7,383.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,383.48

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	0.27
预提费用	22,876.39
合计	22,876.66

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信国证2000指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指数A)	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	5,169,877.61	5,169,877.61
本期申购	615,478.42	615,478.42
本期赎回(以“-”号填列)	-263,884.49	-263,884.49
本期末	5,521,471.54	5,521,471.54

6.4.7.9.2 创金合信国证2000指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指数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	6,543,471.81	6,543,471.81
本期申购	2,289,437.48	2,289,437.48
本期赎回(以“-”号填列)	-2,988,806.54	-2,988,806.54
本期末	5,844,102.75	5,844,102.75

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 创金合信国证2000指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指 数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-745,526.88	-507,658.56	-1,253,185.44
本期利润	401,284.47	526,442.27	927,726.74
本期基金份额交易产 生的变动数	-40,869.33	38,306.52	-2,562.81
其中：基金申购款	-71,473.06	48,523.06	-22,950.00
基金赎回款	30,603.73	-10,216.54	20,387.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-385,111.74	57,090.23	-328,021.51

6.4.7.10.2 创金合信国证2000指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指 数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-952,798.63	-641,598.67	-1,594,397.30
本期利润	443,629.82	701,409.50	1,145,039.32
本期基金份额交易产 生的变动数	93,302.10	-140.01	93,162.09
其中：基金申购款	-269,196.61	222,341.32	-46,855.29
基金赎回款	362,498.71	-222,481.33	140,017.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-415,866.71	59,670.82	-356,195.89

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	1,131.41
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	136.60
其他	10.93
合计	1,278.94

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	8,842,355.93
减：卖出股票成本总额	8,006,832.23
买卖股票差价收入	835,523.70

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	-994.51
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	-994.51

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	331,597.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期	321,026.51

兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	11,565.76
买卖债券差价收入	-994.51

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

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

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	85,650.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	85,650.98

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	1,227,851.77
——股票投资	1,228,980.06
——债券投资	-1,128.29
——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	1,227,851.77

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	9,287.83
转换费收入	3.02
合计	9,290.85

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	22,777.46
银行间市场交易费用	-
合计	22,777.46

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	-
汇划手续费	600.00
指数使用费	16,000.00
合计	31,476.39

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
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
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02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30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	17,238,607.93	99.88%	19,290,433.28	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02月07日（基金合同生效日）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	661,058.80	100.00%	591,046.20	100.00%

6.4.10.1.4 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	12,390.64	99.94%	7,383.48	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）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	13,858.20	100.00%	6,091.20	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02月07日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,077.24	21,712.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,398.94	615.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。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、公休日等，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 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,215.47	4,342.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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		
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C	合计
创金合信 直销	0.00	4,562.40	4,562.40

合计	0.00	4,562.40	4,562.40
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C	合计
创金合信 直销	0.00	4,048.23	4,048.23
合计	0.00	4,048.23	4,048.23

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，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，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、公休日等，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

创金合信国证2000指数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02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基	-	5,000,200.04

金份额		
报告期初持有的基金份额	5,000,200.04	-
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	5,000,200.04	5,000,200.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	90.56%	95.44%

创金合信国证2000指数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02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	-	5,000,200.00
报告期初持有的基金份额	5,000,200.00	-
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	5,000,200.00	5,000,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	85.56%	89.79%

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02月07日（基金合同生效日）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
招商银行股份有限公司	343,076.49	1,131.41	123,867.75	4,159.48

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。

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的证券。

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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	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				
6000 95	哈高科	2019 -06- 18	重大 事项 停牌	5.62	2019 -07- 02	6.18	4,000	15,773.38	22,480.00	-

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。

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	320,192.00	-
合计	320,192.00	-

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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	301,320.00
合计	-	301,320.00

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约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0.00%。

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10,688,229.65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	343,076.49	-	-	-	343,076.49
结算备付金	11,744.14	-	-	-	11,744.14
存出保证金	1,484.19	-	-	-	1,484.19
交易性金融资产	320,192.00	-	-	10,039,328.23	10,359,520.23
应收利息	-	-	-	8,118.83	8,118.83
应收申购款	-	-	-	1,076.40	1,076.40
资产总计	676,496.82	-	-	10,048,523.46	10,725,020.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,280.01	7,280.01

应付管理人报酬	-	-	-	4,351.94	4,351.94
应付托管费	-	-	-	870.39	870.39
应付销售服务费	-	-	-	900.91	900.91
应付交易费用	-	-	-	7,383.48	7,383.48
其他负债	-	-	-	22,876.66	22,876.66
负债总计	-	-	-	43,663.39	43,663.39
利率敏感度缺口	676,496.82	-	-	10,004,860.07	10,681,356.89
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	296,036.24	-	-	-	296,036.24
结算备付金	3,035.94	-	-	-	3,035.94
存出保证金	1,128.54	-	-	-	1,128.54
交易性金融资产	301,320.00	-	-	8,400,001.40	8,701,321.40
应收证券清算款	-	-	-	55,035.83	55,035.83
应收利息	-	-	-	8,453.77	8,453.77
应收申购款	-	-	-	9,125.00	9,125.00

资产总计	601,520.72	-	-	8,472,616.00	9,074,136.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	71,750.98	71,750.98
应付赎回款	-	-	-	4,747.29	4,747.29
应付管理人报酬	-	-	-	3,942.06	3,942.06
应付托管费	-	-	-	788.41	788.41
应付销售服务费	-	-	-	879.63	879.63
应付交易费用	-	-	-	3,261.66	3,261.66
其他负债	-	-	-	123,000.01	123,000.01
负债总计	-	-	-	208,370.04	208,370.04
利率敏感度缺口	601,520.72	-	-	8,264,245.96	8,865,766.68

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3.00%(2018年12月31日：3.40%)，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	10,039,328.23	93.99	8,400,001.40	94.75
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	10,039,328.23	93.99	8,400,001.40	94.75

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	510,583.37	434,536.28
	比较基准下降5%资产净值变动	-510,583.37	-434,536.28

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10,016,848.23元，属于第二层次的余额为342,672.00元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次8,400,001.40元，第二层次301,320.00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	10,039,328.23	93.61
	其中：股票	10,039,328.23	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	320,192.00	2.99
	其中：债券	320,192.00	2.99
	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	354,820.63	3.31
8	其他各项资产	10,679.42	0.10
9	合计	10,725,020.28	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	147,937.40	1.39
B	采矿业	42,664.00	0.40

C	制造业	6,498,383.10	60.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	252,568.04	2.36
E	建筑业	290,252.00	2.72
F	批发和零售业	594,044.20	5.56
G	交通运输、仓储和邮政业	267,889.10	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	911,753.74	8.54
J	金融业	47,265.00	0.44
K	房地产业	315,395.80	2.95
L	租赁和商务服务业	92,323.60	0.86
M	科学研究和技术服务业	221,301.85	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	160,588.40	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,459.00	0.29
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	71,427.00	0.67
S	综合	95,076.00	0.89
	合计	10,039,328.23	93.99

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
----	------	------	-------	---------	-------

					产净 值比 例(%)
1	603686	龙马环卫	2,000	39,760.00	0.37
2	600557	康缘药业	2,600	38,636.00	0.36
3	600529	山东药玻	1,624	36,994.72	0.35
4	002329	皇氏集团	7,500	36,975.00	0.35
5	600305	恒顺醋业	1,980	36,471.60	0.34
6	300463	迈克生物	1,400	35,182.00	0.33
7	600363	联创光电	2,600	34,736.00	0.33
8	600284	浦东建设	4,300	33,110.00	0.31
9	002557	洽洽食品	1,300	32,825.00	0.31
10	000739	普洛药业	3,200	31,456.00	0.29
11	002402	和而泰	3,300	31,251.00	0.29
12	000931	中 关 村	3,500	31,045.00	0.29
13	601677	明泰铝业	3,000	30,930.00	0.29
14	600936	广西广电	6,300	30,555.00	0.29
15	600661	昂立教育	1,300	30,459.00	0.29
16	000799	酒鬼酒	1,200	30,300.00	0.28
17	002738	中矿资源	1,700	29,988.00	0.28
18	300226	上海钢联	400	29,984.00	0.28
19	600422	昆药集团	2,600	29,978.00	0.28
20	600720	祁连山	3,400	29,886.00	0.28
21	002449	国星光电	2,240	29,747.20	0.28
22	002442	龙星化工	5,300	29,680.00	0.28
23	002531	天顺风能	4,900	29,596.00	0.28
24	600641	万业企业	2,500	29,550.00	0.28
25	300369	绿盟科技	2,300	29,463.00	0.28
26	000720	新能泰山	5,500	29,370.00	0.27
27	603222	济民制药	700	29,183.00	0.27
28	300494	盛天网络	2,500	29,175.00	0.27

29	603566	普莱柯	2,400	29,088.00	0.27
30	603018	中设集团	2,333	29,045.85	0.27
31	002317	众生药业	3,400	28,934.00	0.27
32	002206	海利得	7,000	28,910.00	0.27
33	000913	钱江摩托	2,800	28,840.00	0.27
34	603588	高能环境	2,700	28,809.00	0.27
35	600824	益民集团	7,400	28,786.00	0.27
36	600599	熊猫金控	1,900	28,785.00	0.27
37	002550	千红制药	6,200	28,768.00	0.27
38	002063	远光软件	3,300	28,743.00	0.27
39	603601	再升科技	3,610	28,735.60	0.27
40	600756	浪潮软件	1,200	28,704.00	0.27
41	002331	皖通科技	2,800	28,616.00	0.27
42	002064	华峰氨纶	5,700	28,614.00	0.27
43	300284	苏交科	3,100	28,613.00	0.27
44	600198	大唐电信	2,200	28,600.00	0.27
45	300081	恒信东方	2,300	28,566.00	0.27
46	002649	博彦科技	3,200	28,512.00	0.27
47	300595	欧普康视	800	28,480.00	0.27
48	300079	数码科技	5,000	28,450.00	0.27
49	002332	仙琚制药	4,200	28,392.00	0.27
50	603669	灵康药业	3,780	28,350.00	0.27
51	300183	东软载波	1,800	28,224.00	0.26
52	300440	运达科技	3,500	28,140.00	0.26
53	002145	中核钛白	6,800	28,084.00	0.26
54	002272	川润股份	5,100	28,050.00	0.26
55	000420	吉林化纤	10,500	28,035.00	0.26
56	600976	健民集团	1,700	28,033.00	0.26
57	002284	亚太股份	5,200	28,028.00	0.26
58	600195	中牧股份	2,020	27,977.00	0.26
59	600478	科力远	5,000	27,950.00	0.26

60	600986	科达股份	6,600	27,918.00	0.26
61	600611	大众交通	6,000	27,900.00	0.26
62	300151	昌红科技	4,300	27,864.00	0.26
63	600594	益佰制药	5,300	27,825.00	0.26
64	600285	羚锐制药	3,300	27,819.00	0.26
65	000096	广聚能源	2,900	27,782.00	0.26
66	002658	雪迪龙	3,200	27,776.00	0.26
67	002756	永兴特钢	1,900	27,740.00	0.26
68	300025	华星创业	3,900	27,690.00	0.26
69	000875	吉电股份	8,700	27,666.00	0.26
70	603368	柳药股份	840	27,619.20	0.26
71	600602	云赛智联	3,600	27,612.00	0.26
72	002705	新宝股份	2,400	27,600.00	0.26
73	300447	全信股份	2,500	27,600.00	0.26
74	300327	中颖电子	1,320	27,588.00	0.26
75	300365	恒华科技	1,700	27,557.00	0.26
76	600184	光电股份	2,400	27,528.00	0.26
77	000777	中核科技	2,000	27,500.00	0.26
78	300008	天海防务	7,100	27,477.00	0.26
79	002034	旺能环境	1,600	27,456.00	0.26
80	002476	宝莫股份	4,400	27,456.00	0.26
81	002073	软控股份	4,700	27,448.00	0.26
82	002590	万安科技	3,400	27,370.00	0.26
83	600727	鲁北化工	4,100	27,306.00	0.26
84	000601	韶能股份	5,700	27,303.00	0.26
85	000657	中钨高新	3,900	27,300.00	0.26
86	002345	潮宏基	6,000	27,300.00	0.26
87	603128	华贸物流	2,900	27,260.00	0.26
88	002205	国统股份	1,400	27,258.00	0.26
89	603903	中持股份	1,680	27,182.40	0.25
90	600358	国旅联合	6,200	27,156.00	0.25

91	600108	亚盛集团	7,800	27,144.00	0.25
92	000920	南方汇通	3,500	27,125.00	0.25
93	002462	嘉事堂	1,800	27,000.00	0.25
94	000546	金圆股份	2,800	26,992.00	0.25
95	000417	合肥百货	5,200	26,988.00	0.25
96	300193	佳士科技	3,300	26,961.00	0.25
97	002149	西部材料	2,800	26,936.00	0.25
98	002734	利民股份	1,800	26,928.00	0.25
99	600838	上海九百	3,800	26,904.00	0.25
100	600668	尖峰集团	2,100	26,880.00	0.25
101	002123	梦网集团	1,900	26,866.00	0.25
102	000545	金浦钛业	6,800	26,860.00	0.25
103	002685	华东重机	4,600	26,818.00	0.25
104	603177	德创环保	2,300	26,818.00	0.25
105	002171	楚江新材	4,200	26,712.00	0.25
106	600073	上海梅林	2,900	26,680.00	0.25
107	600360	华微电子	4,100	26,609.00	0.25
108	002564	天沃科技	4,600	26,588.00	0.25
109	000915	山大华特	1,300	26,585.00	0.25
110	600650	锦江投资	2,200	26,510.00	0.25
111	000632	三木集团	4,700	26,508.00	0.25
112	601929	吉视传媒	10,900	26,487.00	0.25
113	600981	汇鸿集团	5,500	26,455.00	0.25
114	603989	艾华集团	1,400	26,432.00	0.25
115	000733	振华科技	1,600	26,368.00	0.25
116	600116	三峡水利	3,300	26,334.00	0.25
117	300161	华中数控	1,800	26,334.00	0.25
118	600692	亚通股份	3,400	26,316.00	0.25
119	601126	四方股份	4,400	26,312.00	0.25
120	002495	佳隆股份	7,800	26,286.00	0.25
121	600356	恒丰纸业	3,600	26,280.00	0.25

122	300364	中文在线	5,700	26,277.00	0.25
123	002785	万里石	2,700	26,271.00	0.25
124	600220	江苏阳光	10,900	26,269.00	0.25
125	600708	光明地产	4,700	26,226.00	0.25
126	603660	苏州科达	1,680	26,191.20	0.25
127	000838	财信发展	7,000	26,180.00	0.25
128	002467	二六三	4,260	26,156.40	0.24
129	601058	赛轮轮胎	8,800	26,136.00	0.24
130	002334	英威腾	4,700	26,132.00	0.24
131	300432	富临精工	3,800	26,030.00	0.24
132	002240	威华股份	3,100	26,009.00	0.24
133	300254	仟源医药	3,300	26,004.00	0.24
134	600496	精工钢构	8,200	25,994.00	0.24
135	603066	音飞储存	3,500	25,935.00	0.24
136	600831	广电网络	2,400	25,920.00	0.24
137	600071	凤凰光学	2,400	25,920.00	0.24
138	600222	太龙药业	5,500	25,905.00	0.24
139	000936	华西股份	2,900	25,897.00	0.24
140	000652	泰达股份	6,600	25,872.00	0.24
141	600200	江苏吴中	4,400	25,872.00	0.24
142	002214	大立科技	2,700	25,839.00	0.24
143	603788	宁波高发	1,900	25,802.00	0.24
144	000501	鄂武商 A	2,400	25,800.00	0.24
145	300020	银江股份	3,200	25,792.00	0.24
146	002474	榕基软件	3,000	25,770.00	0.24
147	002698	博实股份	2,850	25,764.00	0.24
148	600366	宁波韵升	2,800	25,704.00	0.24
149	300629	新劲刚	1,100	25,696.00	0.24
150	002533	金杯电工	5,000	25,650.00	0.24
151	600169	太原重工	9,600	25,632.00	0.24
152	002540	亚太科技	5,400	25,596.00	0.24

153	300030	阳普医疗	4,600	25,576.00	0.24
154	002469	三维工程	6,000	25,560.00	0.24
155	002099	海翔药业	3,600	25,560.00	0.24
156	600850	华东电脑	1,200	25,548.00	0.24
157	603039	泛微网络	344	25,524.80	0.24
158	002045	国光电器	4,700	25,521.00	0.24
159	600587	新华医疗	1,600	25,520.00	0.24
160	002269	美邦服饰	9,700	25,511.00	0.24
161	000779	甘咨询	2,400	25,464.00	0.24
162	300047	天源迪科	3,042	25,461.54	0.24
163	600405	动力源	5,100	25,449.00	0.24
164	600736	苏州高新	3,100	25,420.00	0.24
165	300534	陇神戎发	4,100	25,420.00	0.24
166	603008	喜临门	2,300	25,369.00	0.24
167	002438	江苏神通	3,100	25,358.00	0.24
168	603113	金能科技	2,300	25,346.00	0.24
169	002106	莱宝高科	3,600	25,344.00	0.24
170	300232	洲明科技	2,616	25,322.88	0.24
171	300201	海伦哲	5,200	25,272.00	0.24
172	002253	川大智胜	1,700	25,262.00	0.24
173	603308	应流股份	2,600	25,246.00	0.24
174	002082	万邦德	2,700	25,245.00	0.24
175	600580	卧龙电驱	3,000	25,230.00	0.24
176	600020	中原高速	4,800	25,200.00	0.24
177	600851	海欣股份	3,400	25,194.00	0.24
178	002234	民和股份	900	25,191.00	0.24
179	002443	金洲管道	3,500	25,165.00	0.24
180	002104	恒宝股份	3,500	25,165.00	0.24
181	600479	千金药业	2,700	25,164.00	0.24
182	002041	登海种业	2,300	25,162.00	0.24
183	000609	中迪投资	4,700	25,145.00	0.24

184	000973	佛塑科技	6,100	25,132.00	0.24
185	603188	ST亚邦	3,200	25,120.00	0.24
186	002781	奇信股份	1,400	25,116.00	0.24
187	600764	中国海防	900	25,092.00	0.23
188	600456	宝钛股份	1,100	25,091.00	0.23
189	002293	罗莱生活	2,530	25,072.30	0.23
190	002489	浙江永强	7,500	25,050.00	0.23
191	300045	华力创通	2,800	25,032.00	0.23
192	600288	大恒科技	2,200	25,014.00	0.23
193	600855	航天长峰	1,800	25,002.00	0.23
194	603118	共进股份	2,700	25,002.00	0.23
195	000731	四川美丰	4,300	24,983.00	0.23
196	002036	联创电子	2,730	24,979.50	0.23
197	000543	皖能电力	5,300	24,963.00	0.23
198	600458	时代新材	2,400	24,936.00	0.23
199	600433	冠豪高新	6,600	24,816.00	0.23
200	300111	向日葵	9,500	24,795.00	0.23
201	002055	得润电子	2,300	24,794.00	0.23
202	600097	开创国际	2,400	24,792.00	0.23
203	002654	万润科技	6,000	24,780.00	0.23
204	600966	博汇纸业	6,500	24,765.00	0.23
205	600251	冠农股份	3,900	24,726.00	0.23
206	600337	美克家居	6,000	24,720.00	0.23
207	000851	高鸿股份	4,200	24,696.00	0.23
208	300577	开润股份	700	24,661.00	0.23
209	002139	拓邦股份	4,250	24,650.00	0.23
210	600162	香江控股	10,100	24,644.00	0.23
211	600527	江南高纤	11,200	24,640.00	0.23
212	600565	迪马股份	6,600	24,618.00	0.23
213	600072	中船科技	1,900	24,586.00	0.23
214	002126	银轮股份	3,300	24,552.00	0.23

215	300303	聚飞光电	7,400	24,494.00	0.23
216	002255	海陆重工	5,500	24,475.00	0.23
217	300185	通裕重工	12,600	24,444.00	0.23
218	000829	天音控股	4,200	24,444.00	0.23
219	300326	凯利泰	2,700	24,435.00	0.23
220	600063	皖维高新	8,700	24,360.00	0.23
221	300419	浩丰科技	4,000	24,360.00	0.23
222	300247	融捷健康	7,400	24,346.00	0.23
223	300470	日机密封	980	24,343.20	0.23
224	002301	齐心集团	2,100	24,339.00	0.23
225	300184	力源信息	2,400	24,336.00	0.23
226	300049	福瑞股份	2,700	24,327.00	0.23
227	600326	西藏天路	3,200	24,320.00	0.23
228	600677	航天通信	1,400	24,318.00	0.23
229	300179	四方达	5,500	24,310.00	0.23
230	002707	众信旅游	4,000	24,280.00	0.23
231	002706	良信电器	4,300	24,252.00	0.23
232	002286	保龄宝	4,100	24,231.00	0.23
233	300067	安诺其	5,300	24,221.00	0.23
234	600187	国中水务	8,200	24,190.00	0.23
235	603628	清源股份	3,000	24,180.00	0.23
236	300238	冠昊生物	1,200	24,168.00	0.23
237	300335	迪森股份	3,700	24,161.00	0.23
238	002538	司尔特	4,700	24,158.00	0.23
239	002488	金固股份	2,900	24,157.00	0.23
240	000573	粤宏远 A	7,200	24,120.00	0.23
241	600742	一汽富维	2,260	24,114.20	0.23
242	300412	迦南科技	3,600	24,084.00	0.23
243	002452	长高集团	5,900	24,072.00	0.23
244	600481	双良节能	6,500	24,050.00	0.23
245	000565	渝三峡 A	4,100	24,026.00	0.22

246	600609	金杯汽车	5,800	24,012.00	0.22
247	002079	苏州固锔	3,300	23,991.00	0.22
248	600425	青松建化	5,400	23,976.00	0.22
249	300237	美晨生态	6,100	23,973.00	0.22
250	300112	万讯自控	3,000	23,940.00	0.22
251	000036	华联控股	4,680	23,914.80	0.22
252	002448	中原内配	4,300	23,908.00	0.22
253	600210	紫江企业	5,900	23,895.00	0.22
254	002510	天汽模	5,900	23,895.00	0.22
255	002523	天桥起重	6,900	23,874.00	0.22
256	600261	阳光照明	6,500	23,855.00	0.22
257	002832	比音勒芬	500	23,835.00	0.22
258	601567	三星医疗	4,100	23,780.00	0.22
259	601010	文峰股份	6,900	23,736.00	0.22
260	600452	涪陵电力	1,344	23,735.04	0.22
261	000510	新金路	5,200	23,712.00	0.22
262	002097	山河智能	3,800	23,712.00	0.22
263	603011	合锻智能	4,600	23,690.00	0.22
264	603117	万林物流	5,760	23,673.60	0.22
265	002169	智光电气	4,500	23,670.00	0.22
266	002277	友阿股份	7,000	23,660.00	0.22
267	600249	两面针	5,200	23,660.00	0.22
268	300195	长荣股份	2,800	23,632.00	0.22
269	000969	安泰科技	2,800	23,632.00	0.22
270	603328	依顿电子	2,300	23,621.00	0.22
271	300043	星辉娱乐	4,900	23,618.00	0.22
272	002196	方正电机	3,700	23,606.00	0.22
273	000801	四川九洲	3,900	23,595.00	0.22
274	300101	振芯科技	2,300	23,575.00	0.22
275	603999	读者传媒	4,200	23,478.00	0.22
276	000882	华联股份	9,200	23,460.00	0.22

277	002222	福晶科技	2,100	23,457.00	0.22
278	002391	长青股份	3,050	23,454.50	0.22
279	000789	万年青	2,340	23,446.80	0.22
280	603730	岱美股份	1,000	23,440.00	0.22
281	000823	超声电子	2,500	23,425.00	0.22
282	300422	博世科	2,100	23,331.00	0.22
283	000554	泰山石油	3,900	23,322.00	0.22
284	002432	九安医疗	4,300	23,220.00	0.22
285	002458	益生股份	1,190	23,216.90	0.22
286	600558	大西洋	6,500	23,205.00	0.22
287	000680	山推股份	5,600	23,184.00	0.22
288	002762	金发拉比	4,000	23,120.00	0.22
289	300349	金卡智能	1,300	23,114.00	0.22
290	002567	唐人神	2,000	23,100.00	0.22
291	000757	浩物股份	4,800	23,088.00	0.22
292	600512	腾达建设	8,100	23,085.00	0.22
293	600761	安徽合力	2,400	23,040.00	0.22
294	600110	诺德股份	5,200	23,036.00	0.22
295	603363	傲农生物	1,200	22,992.00	0.22
296	600279	重庆港九	4,900	22,932.00	0.21
297	000903	云内动力	8,100	22,923.00	0.21
298	600006	东风汽车	4,300	22,919.00	0.21
299	600316	洪都航空	1,600	22,896.00	0.21
300	300091	金通灵	4,600	22,862.00	0.21
301	002182	云海金属	3,000	22,830.00	0.21
302	300120	经纬辉开	3,600	22,824.00	0.21
303	600106	重庆路桥	7,110	22,823.10	0.21
304	002314	南山控股	7,600	22,800.00	0.21
305	002775	文科园林	3,700	22,792.00	0.21
306	300138	晨光生物	3,200	22,784.00	0.21
307	000837	秦川机床	5,100	22,746.00	0.21

308	300057	万顺新材	4,267	22,700.44	0.21
309	002100	天康生物	2,800	22,680.00	0.21
310	600114	东睦股份	3,604	22,669.16	0.21
311	002229	鸿博股份	3,000	22,650.00	0.21
312	002425	凯撒文化	3,500	22,645.00	0.21
313	002455	百川股份	3,600	22,608.00	0.21
314	300066	三川智慧	4,200	22,596.00	0.21
315	002453	华软科技	3,800	22,572.00	0.21
316	000616	海航投资	7,600	22,572.00	0.21
317	002516	旷达科技	7,700	22,561.00	0.21
318	000529	广弘控股	3,800	22,534.00	0.21
319	300228	富瑞特装	3,700	22,496.00	0.21
320	600095	哈高科	4,000	22,480.00	0.21
321	600791	京能置业	5,300	22,472.00	0.21
322	603980	吉华集团	2,480	22,468.80	0.21
323	002826	易明医药	2,200	22,462.00	0.21
324	000407	胜利股份	5,800	22,446.00	0.21
325	300379	东方通	1,100	22,440.00	0.21
326	002746	仙坛股份	1,450	22,431.50	0.21
327	603005	晶方科技	1,200	22,416.00	0.21
328	600397	安源煤业	8,300	22,410.00	0.21
329	603189	网达软件	1,400	22,400.00	0.21
330	000958	东方能源	3,500	22,400.00	0.21
331	002413	雷科防务	3,500	22,365.00	0.21
332	002276	万马股份	4,100	22,345.00	0.21
333	603717	天域生态	2,400	22,344.00	0.21
334	002527	新时达	4,200	22,302.00	0.21
335	002093	国脉科技	2,400	22,296.00	0.21
336	600624	复旦复华	2,000	22,280.00	0.21
337	300572	安车检测	480	22,272.00	0.21
338	300130	新国都	1,400	22,260.00	0.21

339	000836	富通鑫茂	5,000	22,250.00	0.21
340	002313	日海智能	1,100	22,220.00	0.21
341	300292	吴通控股	3,700	22,200.00	0.21
342	002481	双塔食品	3,000	22,170.00	0.21
343	600211	西藏药业	700	22,162.00	0.21
344	000682	东方电子	4,700	22,090.00	0.21
345	000672	上峰水泥	1,800	22,086.00	0.21
346	603007	花王股份	2,600	22,074.00	0.21
347	600096	云天化	3,700	22,052.00	0.21
348	002067	景兴纸业	6,400	22,016.00	0.21
349	002136	安纳达	2,600	21,996.00	0.21
350	600517	置信电气	3,000	21,960.00	0.21
351	002117	东港股份	2,100	21,945.00	0.21
352	600898	国美通讯	2,700	21,924.00	0.21
353	002446	盛路通信	2,300	21,919.00	0.21
354	002130	沃尔核材	4,200	21,882.00	0.20
355	300273	和佳股份	4,200	21,798.00	0.20
356	600620	天宸股份	2,900	21,779.00	0.20
357	300131	英唐智控	4,100	21,730.00	0.20
358	002502	鼎龙文化	6,300	21,672.00	0.20
359	002201	九鼎新材	3,200	21,664.00	0.20
360	000584	哈工智能	3,000	21,660.00	0.20
361	000753	漳州发展	6,800	21,624.00	0.20
362	002148	北纬科技	3,400	21,624.00	0.20
363	300048	合康新能	7,600	21,584.00	0.20
364	300415	伊之密	3,100	21,576.00	0.20
365	603778	乾景园林	5,200	21,528.00	0.20
366	002580	圣阳股份	3,800	21,508.00	0.20
367	300304	云意电气	5,400	21,492.00	0.20
368	603069	海汽集团	3,200	21,472.00	0.20
369	600658	电子城	4,200	21,462.00	0.20

370	600322	天房发展	5,900	21,417.00	0.20
371	300128	锦富技术	5,400	21,384.00	0.20
372	002328	新朋股份	5,100	21,369.00	0.20
373	300535	达威股份	1,500	21,360.00	0.20
374	002480	新筑股份	4,500	21,330.00	0.20
375	601886	江河集团	3,000	21,330.00	0.20
376	603609	禾丰牧业	1,800	21,312.00	0.20
377	603026	石大胜华	700	21,182.00	0.20
378	002213	特 尔 佳	2,800	21,168.00	0.20
379	002519	银河电子	4,900	21,119.00	0.20
380	002652	扬子新材	5,100	21,114.00	0.20
381	000821	京山轻机	2,600	21,086.00	0.20
382	300438	鹏辉能源	1,300	21,034.00	0.20
383	603223	恒通股份	2,900	21,025.00	0.20
384	002758	华通医药	2,300	20,999.00	0.20
385	300178	腾邦国际	3,400	20,910.00	0.20
386	300141	和顺电气	2,900	20,851.00	0.20
387	300617	安靠智电	900	20,799.00	0.19
388	600105	永鼎股份	4,300	20,726.00	0.19
389	002058	威 尔 泰	1,500	20,610.00	0.19
390	600626	申达股份	3,000	20,520.00	0.19
391	600794	保税科技	4,600	20,516.00	0.19
392	002639	雪人股份	2,500	20,500.00	0.19
393	000688	国城矿业	1,900	20,254.00	0.19
394	300366	创意信息	2,000	20,220.00	0.19
395	300721	怡达股份	1,100	20,207.00	0.19
396	600775	南京熊猫	1,600	19,776.00	0.19
397	000070	特发信息	1,600	19,568.00	0.18
398	000795	英洛华	2,700	19,440.00	0.18
399	300309	吉艾科技	2,800	18,480.00	0.17
400	000159	国际实业	2,400	18,192.00	0.17

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300572	安车检测	69,995.00	0.79
2	603039	泛微网络	64,300.00	0.73
3	002234	民和股份	58,934.00	0.66
4	002124	天邦股份	47,245.00	0.53
5	300595	欧普康视	45,589.00	0.51
6	000070	特发信息	44,931.00	0.51
7	603096	新经典	43,391.00	0.49
8	000584	哈工智能	42,014.00	0.47
9	603806	福斯特	41,008.00	0.46
10	600776	东方通信	40,757.00	0.46
11	002738	中矿资源	39,616.00	0.45
12	002442	龙星化工	39,394.00	0.44
13	300226	上海钢联	37,697.00	0.43
14	300577	开润股份	37,389.00	0.42
15	600604	市北高新	36,612.00	0.41
16	002391	长青股份	36,533.00	0.41
17	002458	益生股份	36,045.00	0.41
18	603669	灵康药业	35,977.00	0.41
19	002329	皇氏集团	35,569.00	0.40
20	600587	新华医疗	35,174.00	0.40

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	000723	美锦能源	87,354.00	0.99
2	600776	东方通信	81,401.00	0.92
3	000735	罗牛山	77,401.00	0.87
4	600975	新五丰	74,523.00	0.84
5	002565	顺灏股份	73,414.50	0.83
6	603338	浙江鼎力	63,025.80	0.71
7	600604	市北高新	59,005.00	0.67
8	600088	中视传媒	54,683.00	0.62
9	002316	亚联发展	54,609.00	0.62
10	600218	全柴动力	53,757.00	0.61
11	600612	老凤祥	52,324.00	0.59
12	002165	红宝丽	52,075.00	0.59
13	300572	安车检测	51,380.00	0.58
14	603998	方盛制药	50,429.00	0.57
15	000990	诚志股份	50,423.00	0.57
16	002124	天邦股份	46,810.00	0.53
17	002166	莱茵生物	46,801.00	0.53
18	002537	海联金汇	45,557.00	0.51
19	002663	普邦股份	45,402.00	0.51
20	300226	上海钢联	45,357.00	0.51

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	8,417,179.00
卖出股票收入（成交）总额	8,842,355.93

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,192.00	3.00
	其中：政策性金融债	320,192.00	3.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	320,192.00	3.00

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	3,200	320,192.00	3.00

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	1,484.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,118.83
5	应收申购款	1,076.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,679.42

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 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
创金合信国证2000指数A	158	34,946.02	5,000,200.04	90.56%	521,271.50	9.44%
创金合信国证2000指数C	217	26,931.35	5,000,200.00	85.56%	843,902.75	14.44%
合计	355	32,015.70	10,000,400.04	87.99%	1,365,174.25	12.01%

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	创金合信国证2000指数A	5,586.65	0.10%
	创金合信国证2000指数C	1,011.02	0.02%
	合计	6,597.67	0.06%

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	创金合信国证2000 指数A	0~10
	创金合信国证2000 指数C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	创金合信国证2000 指数A	0
	创金合信国证2000 指数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	10,000,400.0 4	87.99%	10,000,400.0 4	87.99%	36 月
基金管理人高级管理人 员	5,586.65	0.05%	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	10,005,986.6 9	88.04%	10,000,400.0 4	87.99%	36 月

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信国证2000指数 A	创金合信国证2000指数 C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	5,020,388.67	5,037,251.33
本报告期期初基金份额总额	5,169,877.61	6,543,471.81
本报告期基金总申购份额	615,478.42	2,289,437.48
减：本报告期基金总赎回份额	263,884.49	2,988,806.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,521,471.54	5,844,102.75

§ 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。本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	17,238,607.93	99.88%	12,390.64	99.94%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	20,927.00	0.12%	6.95	0.06%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

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
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	661,058.80	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2018年第4	公司官网、证券时报	2019-01-19

	季度报告		
2	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金（2019年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报	2019-03-22
3	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	公司官网、证券时报	2019-03-22
4	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2018年年度报告	公司官网	2019-03-29
5	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	公司官网、证券时报	2019-03-29
6	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2019年第一季度报告	公司官网、证券时报	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	20190101 - 20190630	10,000,400.04	0.00	0.00	10,000,400.04	87.99%
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；</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；
- (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。
- 本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

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、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国证2000指数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