

# 创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

### 2.4 信息披露方式

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

## § 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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证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遵规守信、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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,703,735.44	-
应收利息	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	-	-
资产总计	128,346,974.64	44,170,768.92
<b>负债和所有者权益</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	-	-
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	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	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	130,527,094.95	58,934,800.32
未分配利润	-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	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	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	11,664,508.61	-13,281,531.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	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	-129,806.60	-
股利收益	896,240.87	321,232.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	225,707.17	83,079.65
<b>减：二、费用</b>	<b>2,105,899.99</b>	<b>3,815,296.98</b>
1. 管理人报酬	348,621.45	466,193.88
2. 托管费	65,366.56	87,411.30
3. 销售服务费	51,976.49	25,159.75
4. 交易费用	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	66,676.48	102,408.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>10,950,457.30</b>	<b>-17,616,444.10</b>

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. 基金申购款	65,042,060.32	-2,997,428.89	62,044,631.43
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 关联方关系

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

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。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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	基金管理人的股东、基金代销机构

券” )	
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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 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	1,200,774,342.20	71.39%	3,023,656,411.28	100.00%

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.8.1.3 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0 6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,	41.54%	12,375,	100.00%

	324.30		705.65	
--	--------	--	--------	--

#### 6.4.8.1.4 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0 6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%

#### 6.4.8.1.5 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	502,91 8.10	82.66%	471,061.6 7	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	1,269,4 59.84	100.00%	259,532.5 7	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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至201 9年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8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。

#### 6.4.8.2.2 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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

## 创金合信中证1000增强A

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	0.00	0.00
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	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
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%

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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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0 6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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 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。

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

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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
601236	红塔 证券	2019 -06- 26	2019 -07- 05	新发 流通 受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信 出版	2019 -06- 27	2019 -07- 05	新发 流通 受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-



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
128068	和而转债	2019-06-04	2019-07-01	配债流通受限	100.00	100.00	212	21,200.00	21,200.00	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600510	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	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 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。

##### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于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	9,957,927.00	8.14

	术服务业		
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、环境和公共设施管理业	112,574.00	0.09
O	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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	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

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

## 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	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

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

## 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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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	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	1,872	28,350.22	5,000,166.70	9.42%	48,071,445.02	90.58%

中证1000增强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%	13,900.00	63.47%	-	-	-	-
第一创业证券	4,647,324.30	41.54%	8,000.00	36.53%	-	-	-	-

### § 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	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</p> <p>（1）若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；</p> <p>（2）若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；</p> <p>（3）基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；</p> <p>（4）因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；</p> <p>（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

## 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。

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十七日