

创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2019年01月01日起至2019年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	96
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	96
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	96
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	96
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	96

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.12	投资组合报告附注	97
§9	基金份额持有人信息	99
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	100
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	100
§10	开放式基金份额变动	100
§11	重大事件揭示	101
11.1	基金份额持有人大会决议	101
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	101
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	101
11.4	基金投资策略的改变	101
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	101
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	101
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	102
11.8	其他重大事件	103
§12	影响投资者决策的其他重要信息	105
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	105
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	106
§13	备查文件目录	106
13.1	备查文件目录	106
13.2	存放地点	106
13.3	查阅方式	106

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证500增强	
基金主代码	002311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月31日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	569,406,445.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
下属分级基金的交易代码	002311	002316
报告期末下属分级基金的份额总额	358,836,333.01份	210,570,112.92份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95555
传真		0755-25832571	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

注：本基金自2019年1月19日起常批报社由《证券日报》变更为《中国证券报》。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业

	(特殊普通合伙)	广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年		2018年		2017年	
	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C	创金合信 中证500 增强A	创金合信 中证500 增强C
本期已实现收益	50,074,643.58	28,660,506.97	-52,829,204.32	-33,183,995.84	16,570,999.88	2,912,953.32
本期利润	64,654,561.45	40,848,658.04	-58,746,704.30	-35,450,221.74	18,534,513.80	1,852,451.34
加权平均基金份额本期利润	0.1866	0.2235	-0.2698	-0.3350	0.1046	0.0886
本期加权平均净值利润率	20.13%	24.16%	-28.96%	-37.25%	10.72%	8.92%
本期基金份额净值增长率	31.50%	31.20%	-25.82%	-25.86%	11.26%	11.88%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末		2018年末		2017年末	
期末可供分配利润	-6,497,924.91	-3,368,361.76	-50,185,596.95	-32,223,374.36	5,643,105.94	346,524.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0181	-0.0160	-0.2347	-0.2312	0.0317	0.0369
期末基金资产	361,150,	212,412,	163,613,	107,157,	183,629,	9,733,34

产净值	667.12	000.93	479.92	803.22	225.80	7.52
期末基金份额净值	1.0064	1.0087	0.7653	0.7688	1.0317	1.0369
3.1.3 累计期末指标	2019年末		2018年末		2017年末	
基金份额累计净值增长率	0.64%	0.87%	-23.47%	-23.12%	3.17%	3.69%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.95%	0.85%	6.31%	0.88%	1.64%	-0.03%
过去六个月	9.98%	0.99%	6.15%	1.03%	3.83%	-0.04%
过去一年	31.50%	1.31%	25.16%	1.39%	6.34%	-0.08%
过去三年	8.53%	1.20%	-14.71%	1.26%	23.24%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.64%	1.37%	-30.04%	1.42%	30.68%	-0.05%

创金合信中证500增强C

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

过去三个月	7.93%	0.85%	6.31%	0.88%	1.62%	-0.03%
过去六个月	9.86%	0.99%	6.15%	1.03%	3.71%	-0.04%
过去一年	31.20%	1.31%	25.16%	1.39%	6.04%	-0.08%
过去三年	8.84%	1.20%	-14.71%	1.26%	23.55%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.87%	1.37%	-30.04%	1.42%	30.91%	-0.05%

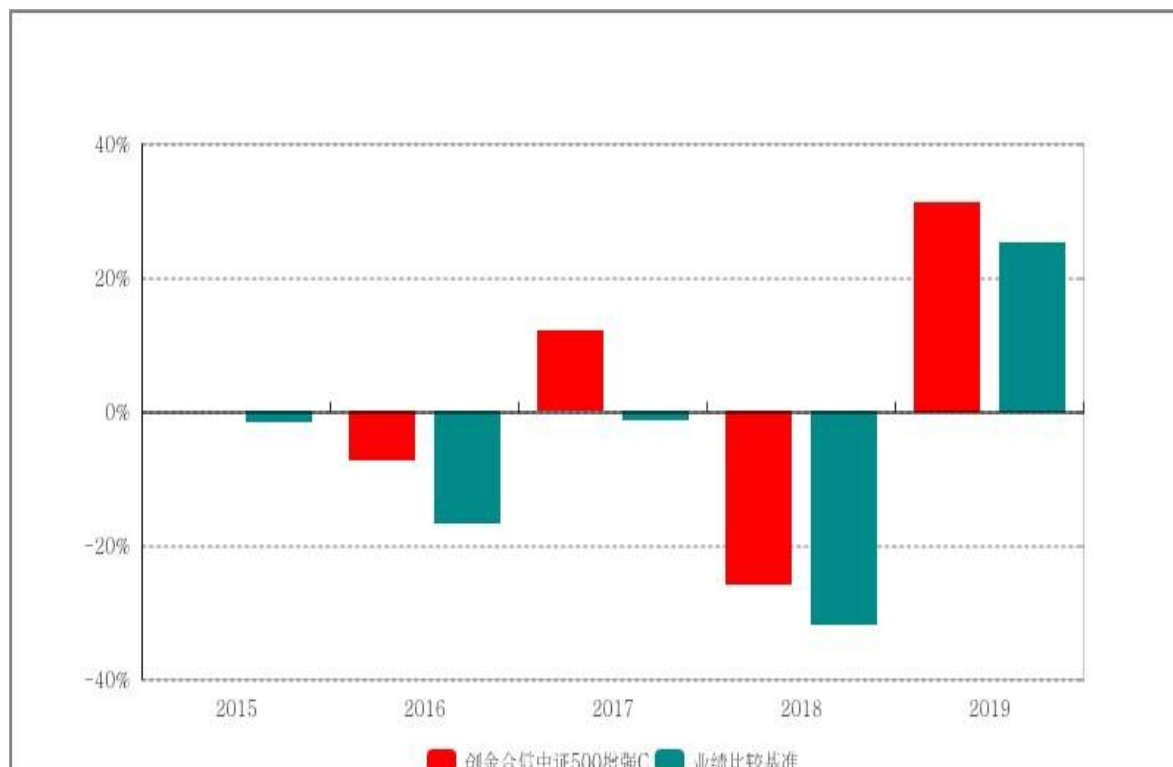
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本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。

报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2019年12月31日，本公司共管理45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19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235.47亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程志田	本基金基金经理	2015-12-31	2019-07-05	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，曾任量化投资部总监、创金合信鑫安保本混合型证券投资基金基金经理(2016年5月11日至2018年5月18日)，创金合信睿合定期开放混合型证券投资基金基金经理(2018年3月12日至2018年10月31日)，创金合信春来回一年定期开

					放混合型发起式证券投资基金基金经理 (2018年6月7日至2019年6月13日), 创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理 (2015年12月31日至2019年7月5日), 创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理 (2015年12月31日至2019年7月5日), 创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金经理 (2016年1月22日至2019年7月5日), 创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2016年9月27日至2019年7月5日), 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理 (2016年12月22日至2019年7月5日), 创金合信量化核心混合型证券投资基金基金经理 (2017年3月27日至2019年7月5日)。
秦昌贵	本基金基金经理、CTA投资部总监	2018-12-04	-	14年	秦昌贵先生, 中国国籍, 华中科技大学金融学硕士。2005年6月加入长江证券股份有限公司, 历任衍生产品部高级研究员, 资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管。2015年7月加入长江证券(上海)资产管理有限公司, 任量化投资部总经理。201

					7年6月加入创金合信基金管理有限公司，现任CTA投资部总监，兼任基金经理。
董梁	本基金基金经理、首席量化官兼任量化指数与国际部总监	2019-07-05	-	15年	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学材料科学博士，2005年3月加入美国巴克莱环球投资者(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，负责美股量化模型开发及投资工作。2009年8月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，负责港股量化模型开发和投资，以及环球股指期货期权的量化投资。2011年1月加入信达国际任执行董事、基金经理，进行港股投资。2012年8月加入华安基金管理有限公司，任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015年加入香港启智资产管理有限公司(Zentific Investment Management)任投资部基金经理。2017年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任首席量化投资官，兼量化指数与国际部总监、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《公开募集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。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，本基金与其他基金构成同日反向且交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共31次，本基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年中国进出口贸易下滑显著，上中下游的景气度总体依次递减。为了刺激经济，宽松政策不断出台，放松专项债使用规则、鼓励银行扩大信贷。猪价上升带来的通货膨胀压力并没有传导入货币政策，仅使食品通胀和核心通胀出现了背离。实体经济融资环境改善偏慢，企业债务违约比例依然偏高，个股选择的风险依然很高。

中证500指数成分中信息技术行业涨幅居前，接近70%，电信、消费等行业超过30%，除信息技术以外，行业分化并没有蓝筹股票严重。中证500指数以中小规模股票为主，在目前的大环境下受到的影响更大，债务违约更容易出现，个股选择风险较高。

本基金以中证500指数为基准，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制跟踪误差，在此基础上追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证500增强A基金份额净值为1.0064元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为31.50%，同期业绩比较基准收益率为25.16%；截至报告期末创金合信中证500增强C基金份额净值为1.0087元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为31.20%，同期业绩比较基准收益率为25.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对后市走势温和看涨。短期来看消费板块受疫情冲击影响最大，休闲服务、餐饮、交通运输等行业的全年业绩将受影响。流动性将保持宽松，疫情影响以及维持地产调控将带来经济下行压力，倒逼政策维持宽松。海外资金持续流入，为市场带来增量资金，部分具备成长性的股票估值有望进一步提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易与异常交易管理制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反

向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第24947号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“创金合信中证500增强基金”）的财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。（二）我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了创金合信中证500增强基金2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准

	<p>则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于创金合信中证500增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	
其他事项	
其他信息	
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>创金合信中证500增强基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估创金合信中证500增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算创金合信中证500增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督创金合信中证500增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由</p>

	<p>于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对创金合信中证500增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致创金合信中证500增强基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹翠丽、李崇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2020-04-28

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,288,543.22	5,802,655.87
结算备付金		13,897,111.13	4,100,186.70
存出保证金		990,135.87	188,562.17
交易性金融资产	7.4.7.2	551,786,521.19	263,789,908.17
其中：股票投资		528,210,321.19	250,215,542.67
基金投资		-	-
债券投资		23,576,200.00	13,574,365.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,284,158.15
应收利息	7.4.7.5	462,040.45	380,976.17
应收股利		-	-
应收申购款		4,585,589.94	861,716.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		580,009,941.80	278,408,164.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,027,735.65	-
应付赎回款		4,251,991.79	6,433,163.95
应付管理人报酬		351,464.08	184,959.73
应付托管费		43,933.00	23,119.97
应付销售服务费		14,765.77	9,067.94
应付交易费用	7.4.7.7	552,954.01	815,854.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	204,429.45	170,714.48
负债合计		6,447,273.75	7,636,880.95
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	569,406,445.93	353,180,254.45
未分配利润	7.4.7.10	4,156,222.12	-82,408,971.31
所有者权益合计		573,562,668.05	270,771,283.14
负债和所有者权益总计		580,009,941.80	278,408,164.09

注：报告截止日2019年12月31日，基金份额总额569,406,445.93份，其中下属A类基金份额358,836,333.01份，C类基金份额210,570,112.92份。下属A类基金份额净值1.0064元，C类基金份额净值1.0087元。

7.2 利润表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日

		1日	8年12月31日
一、收入		120,457,085.72	-80,040,830.31
1. 利息收入		796,349.71	621,871.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	212,331.51	133,831.22
债券利息收入		584,018.20	488,040.38
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）		90,595,686.01	-72,822,351.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	82,255,085.84	-76,471,775.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-84,112.01	22,931.21
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	617,193.84	-
股利收益	7.4.7.15	7,807,518.34	3,626,492.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	26,768,068.94	-8,183,725.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,296,981.06	343,375.74
减：二、费用		14,953,866.23	14,156,095.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,901,521.27	2,383,187.77
2. 托管费	7.4.10.2.2	487,690.13	297,898.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.	168,712.85	95,090.64

	3		
4. 交易费用	7.4.7.18	10,112,375.59	11,148,706.13
5. 利息支出		6,325.21	10,425.80
其中：卖出回购金融资产支出		6,325.21	10,425.80
6. 税金及附加		3,240.40	0.57
7. 其他费用	7.4.7.19	274,000.78	220,786.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		105,503,219.49	-94,196,926.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		105,503,219.49	-94,196,926.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	353,180,254.45	-82,408,971.31	270,771,283.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	105,503,219.49	105,503,219.49
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)	216,226,191.48	-18,938,026.06	197,288,165.42
其中：1. 基金申购款	1,173,602,733.66	-72,790,752.99	1,100,811,980.67

2. 基金赎回款	-957,376,542.18	53,852,726.93	-903,523,815.25
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)	569,406,445.93	4,156,222.12	573,562,668.05
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	187,372,943.19	5,989,630.13	193,362,573.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-94,196,926.04	-94,196,926.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	165,807,311.26	5,798,324.60	171,605,635.86
其中：1. 基金申购款	492,366,826.99	-27,443,786.09	464,923,040.90
2. 基金赎回款	-326,559,515.73	33,242,110.69	-293,317,405.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权	353,180,254.45	-82,408,971.31	270,771,283.14

益（基金净值）			
---------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]3049号《关于准予创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,000,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1505号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2015年12月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4)同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	8,288,543.22	5,802,655.87
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	8,288,543.22	5,802,655.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		510,634,249.33	528,210,321.19	17,576,071.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	23,561,356.56	23,576,200.00	14,843.44
	银行间市场	-	-	-
	合计	23,561,356.56	23,576,200.00	14,843.44
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		534,195,605.89	551,786,521.19	17,590,915.30
项目		上年度末2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		259,256,524.81	250,215,542.67	-9,040,982.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	13,590,412.00	13,574,365.50	-16,046.50
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,590,412.00	13,574,365.50	-16,046.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		272,846,936.81	263,789,908.17	-9,057,028.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31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	5,146,675.00	-	-	-
--股指期货	5,146,675.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,146,675.00	-	-	-
项目	上年度末2018年12月31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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	5,559.05	1,365.70
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	4,451.19	2,029.50
应收债券利息	451,931.10	377,487.58
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	99.11	93.39
合计	462,040.45	380,976.17

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	552,954.01	815,854.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	552,954.01	815,854.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,870.96	20.52
预提费用	200,558.49	170,693.96
合计	204,429.45	170,714.48

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 创金合信中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	213,799,076.87	213,799,076.87
本期申购	658,542,572.70	658,542,572.70
本期赎回(以“-”号填列)	-513,505,316.56	-513,505,316.56
本期末	358,836,333.01	358,836,333.01

7.4.7.9.2 创金合信中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	139,381,177.58	139,381,177.58
本期申购	515,060,160.96	515,060,160.96
本期赎回(以“-”号填列)	-443,871,225.62	-443,871,225.62
本期末	210,570,112.92	210,570,112.92

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 创金合信中证500增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-42,864,827.58	-7,320,769.37	-50,185,596.95
本期利润	50,074,643.58	14,579,917.87	64,654,561.45
本期基金份额交易产生的变动数	-13,707,740.91	1,553,110.52	-12,154,630.39
其中：基金申购款	-49,132,734.23	9,719,927.35	-39,412,806.88
基金赎回款	35,424,993.32	-8,166,816.83	27,258,176.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,497,924.91	8,812,259.02	2,314,334.11

7.4.7.10.2 创金合信中证500增强C

单位：人民币元

项目 (创金合信中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,443,234.92	-4,780,139.44	-32,223,374.36
本期利润	28,660,506.97	12,188,151.07	40,848,658.04
本期基金份额交易产生的变动数	-4,585,633.81	-2,197,761.86	-6,783,395.67
其中：基金申购款	-39,109,845.68	5,731,899.57	-33,377,946.11
基金赎回款	34,524,211.87	-7,929,661.43	26,594,550.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,368,361.76	5,210,249.77	1,841,888.01

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日
活期存款利息收入	99,407.85	48,814.36
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	109,412.70	82,406.88
其他	3,510.96	2,609.98
合计	212,331.51	133,831.22

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	5,416,330,077.57	6,044,068,266.92

减：卖出股票成本总额	5,334,074,991.73	6,120,540,042.43
买卖股票差价收入	82,255,085.84	-76,471,775.51

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-84,112.01	22,931.21
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	-84,112.01	22,931.21

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	39,518,371.03	23,203,686.82
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	38,523,005.94	22,530,123.00
减：应收利息总额	1,079,477.10	650,632.61
买卖债券差价收入	-84,112.01	22,931.21

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 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 12月31日	上年度可比期间收益金额 2018年01月01日至2018年 12月31日
期货投资	617,193.84	-
	-	0.00

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
股票投资产生的股利收益	7,807,518.34	3,626,492.53
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,807,518.34	3,626,492.53

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12 月31日
1. 交易性金融资产	26,647,943.94	-8,183,725.88
——股票投资	26,617,054.00	-8,187,149.98
——债券投资	30,889.94	3,424.10
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2. 衍生工具	120,125.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	120,125.00	-
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	26,768,068.94	-8,183,725.88

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
基金赎回费收入	2,290,622.95	340,983.26
基金转换费收入	6,358.11	2,392.48
合计	2,296,981.06	343,375.74

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
交易所市场交易费用	10,101,675.54	11,148,706.13
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	10,700.05	-
合计	10,112,375.59	11,148,706.13

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

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

	12月31日	12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
汇划手续费	15,970.38	13,122.53
指数使用费	78,030.40	47,663.78
合计	274,000.78	220,786.31

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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。

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	1,833,720,984.59	16.70%	4,899,658,945.08	40.03%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	4,009,940.00	5.93%	12,091,364.93	38.66%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	27,900,000.00	45.07%	1,500,000.00	1.61%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
第一创业 证券股份 有限公司	589,160.13	16.09%	107,000.71	19.35%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
第一创业 证券股份 有限公司	1,569,780.21	39.07%	-	-

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年01月01日至201 9年12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,901,521.27	2,383,187.77
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,277,478.28	272,950.67

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	487,690.13	297,898.51

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
招商银行	0.00	7,157.20	7,157.20
第一创业证券	0.00	995.40	995.40
创金合信直销	0.00	49,986.20	49,986.20
合计	0.00	58,138.80	58,138.80
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C	合计
招商银行	0.00	2,616.59	2,616.59
创金合信直销	0.00	65,163.57	65,163.57
第一创业证券	0.00	17.16	17.16
合计	0.00	67,797.32	67,797.32

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信中证500增强A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12 月31日
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.39%	2.34%

创金合信中证500增强C

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12月31日		2018年01月01日至2018年12月31日	
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	-		-	
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00		5,000,000.00	
报告期间申购/买入总份额	-		-	
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	5,000,000.00		5,000,000.00	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.37%		3.59%	

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年01月01日至2019年12月31日		2018年01月01日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	8,288,543.22	99,407.85	5,802,655.87	48,814.36

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	新股锁定	4.94	4.66	294,195	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688188	柏楚电子	2019-07-31	2020-02-10	新股锁定	68.58	152.09	7,847	538,147.26	1,193,450.23	-
688299	长阳科技	2019-10-28	2020-05-06	新股锁定	13.71	15.74	11,341	155,485.11	178,507.34	-
688138	清溢光电	2019-11-13	2020-05-20	新股锁定	8.78	13.89	10,066	88,379.48	139,816.74	-
688058	宝兰德	2019-10-25	2020-05-06	新股锁定	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新发流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
0029	侨银	2019	2020	新发	5.74	5.74	1,146	6,57	6,57	-

73	环保	-12- 27	-01- 06	流通 受限				8.04	8.04	
----	----	------------	------------	----------	--	--	--	------	------	--

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手和债券的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	14,508,700.00	-
合计	14,508,700.00	-

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	14,965.50
未评级	9,067,500.00	13,559,400.00
合计	9,067,500.00	13,574,365.50

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2019年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2019年12月31日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.54%。

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12月31日,本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为562,002,895.77元,超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019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	8,288,543.22	-	-	-	8,288,543.22
结算备付金	13,897,111.13	-	-	-	13,897,111.13
存出保证金	990,135.87	-	-	-	990,135.87
交易性金融资产	23,576,200.00	-	-	528,210,321.19	551,786,521.19
应收利息	-	-	-	462,040.45	462,040.45
应收申购款	-	-	-	4,585,589.94	4,585,589.94
资产总计	46,751,990.22	-	-	533,257,951.58	580,009,941.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,027,735.65	1,027,735.65

应付赎回款	-	-	-	4,251,991.79	4,251,991.79
应付管理人报酬	-	-	-	351,464.08	351,464.08
应付托管费	-	-	-	43,933.00	43,933.00
应付销售服务费	-	-	-	14,765.77	14,765.77
应付交易费用	-	-	-	552,954.01	552,954.01
其他负债	-	-	-	204,429.45	204,429.45
负债总计	-	-	-	6,447,273.75	6,447,273.75
利率敏感度缺口	46,751,990.22	-	-	526,810,677.83	573,562,668.05
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	5,802,655.87	-	-	-	5,802,655.87
结算备付金	4,100,186.70	-	-	-	4,100,186.70
存出保证金	188,562.17	-	-	-	188,562.17
交易性金融资产	13,559,400.00	-	14,965.50	250,215,542.67	263,789,908.17
应收证券清算款	-	-	-	3,284,158.15	3,284,158.15
应收利息	-	-	-	380,976.17	380,976.17

应收申购款	-	-	-	861,716.86	861,716.86
资产总计	23,650,804.74	-	14,965.50	254,742,393.85	278,408,164.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,433,163.95	6,433,163.95
应付管理人报酬	-	-	-	184,959.73	184,959.73
应付托管费	-	-	-	23,119.97	23,119.97
应付销售服务费	-	-	-	9,067.94	9,067.94
应付交易费用	-	-	-	815,854.88	815,854.88
其他负债	-	-	-	170,714.48	170,714.48
负债总计	-	-	-	7,636,880.95	7,636,880.95
利率敏感度缺口	23,650,804.74	-	14,965.50	247,105,512.90	270,771,283.14

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.11%(2018年12月31日：5.01%)，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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	528,210,321.19	92.09	250,215,542.67	92.41
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	528,210,321.19	92.09	250,215,542.67	92.41

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单

		位：人民币元)	
		本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
	比较基准上涨5%	27,005,387.41	12,457,573.17
	比较基准下降5%	-27,005,387.41	-12,457,573.17

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为525,100,631.51元，属于第二层次的余额为26,685,889.68元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次249,329,099.37元，第二层次14,460,808.80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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	528,210,321.19	91.07
	其中：股票	528,210,321.19	91.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,576,200.00	4.06
	其中：债券	23,576,200.00	4.06
	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	22,185,654.35	3.83
8	其他各项资产	6,037,766.26	1.04
9	合计	580,009,941.80	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	988,647.18	0.17
B	采矿业	11,576,805.98	2.02
C	制造业	232,647,396.67	40.56
D	电力、热力、燃气及水生	11,377,405.01	1.98

	产和供应业		
E	建筑业	5,457,777.15	0.95
F	批发和零售业	29,141,544.97	5.08
G	交通运输、仓储和邮政业	16,083,322.88	2.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,707,349.08	8.67
J	金融业	28,335,422.75	4.94
K	房地产业	22,462,109.24	3.92
L	租赁和商务服务业	6,089,188.05	1.06
M	科学研究和技术服务业	2,415,622.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	2,462,380.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	525,888.00	0.09
Q	卫生和社会工作	4,680,780.11	0.82
R	文化、体育和娱乐业	12,639,759.79	2.20
S	综合	1,760,756.00	0.31
	合计	438,352,154.86	76.43

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,892,037.58	1.03
C	制造业	57,552,314.48	10.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	411,714.00	0.07
E	建筑业	4,233,489.00	0.74
F	批发和零售业	3,437,196.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	118.69	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,284,892.43	1.44
J	金融业	5,993,189.61	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,469,160.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,515,264.50	0.44
R	文化、体育和娱乐业	62,212.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	89,858,166.33	15.67

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	324,200	6,441,854.00	1.12
2	002439	启明星辰	181,275	6,127,095.00	1.07
3	002049	紫光国微	120,494	6,125,914.96	1.07
4	600739	辽宁成大	389,098	5,925,962.54	1.03
5	002065	东华软件	570,700	5,889,624.00	1.03
6	601233	桐昆股份	392,900	5,889,571.00	1.03
7	600745	闻泰科技	54,900	5,078,250.00	0.89

8	300253	卫宁健康	330,982	4,958,110.36	0.86
9	300529	健帆生物	68,591	4,927,577.44	0.86
10	000960	锡业股份	466,373	4,868,934.12	0.85
11	002217	合力泰	874,604	4,854,052.20	0.85
12	000031	大悦城	668,600	4,800,548.00	0.84
13	600376	首开股份	597,600	4,762,872.00	0.83
14	002028	思源电气	343,200	4,725,864.00	0.82
15	300316	晶盛机电	296,900	4,667,268.00	0.81
16	601000	唐山港	1,785,020	4,641,052.00	0.81
17	600037	歌华有线	514,577	4,636,338.77	0.81
18	600827	百联股份	507,300	4,555,554.00	0.79
19	002414	高德红外	216,706	4,550,826.00	0.79
20	300182	捷成股份	1,278,689	4,462,624.61	0.78
21	002180	纳思达	132,717	4,369,043.64	0.76
22	002048	宁波华翔	282,400	4,365,904.00	0.76
23	000028	国药一致	96,213	4,364,221.68	0.76
24	601958	金钼股份	544,600	4,362,246.00	0.76
25	000877	天山股份	365,300	4,328,805.00	0.75
26	600064	南京高科	442,600	4,315,350.00	0.75
27	300134	大富科技	277,450	4,278,279.00	0.75
28	300002	神州泰岳	1,293,127	4,215,594.02	0.73
29	600056	中国医药	322,700	4,211,235.00	0.73
30	002358	森源电气	598,800	4,185,612.00	0.73
31	601326	秦港股份	1,305,600	4,164,864.00	0.73
32	002544	杰赛科技	304,500	4,147,290.00	0.72
33	000930	中粮科技	613,200	4,047,120.00	0.71
34	000807	云铝股份	749,718	3,853,550.52	0.67
35	601019	山东出版	551,913	3,835,795.35	0.67
36	600155	华创阳安	268,900	3,772,667.00	0.66
37	002075	沙钢股份	582,200	3,627,106.00	0.63
38	000066	中国长城	231,684	3,605,003.04	0.63

39	002936	郑州银行	769,653	3,578,886.45	0.62
40	000987	越秀金控	356,900	3,451,223.00	0.60
41	600845	宝信软件	103,700	3,411,730.00	0.59
42	002463	沪电股份	151,600	3,367,036.00	0.59
43	002440	闰土股份	298,891	3,347,579.20	0.58
44	002384	东山精密	137,300	3,178,495.00	0.55
45	601128	常熟银行	334,600	3,048,206.00	0.53
46	300014	亿纬锂能	59,300	2,974,488.00	0.52
47	600763	通策医疗	24,602	2,522,443.06	0.44
48	002745	木林森	183,000	2,490,630.00	0.43
49	000623	吉林敖东	150,100	2,481,153.00	0.43
50	002465	海格通信	225,700	2,444,331.00	0.43
51	002129	中环股份	204,500	2,415,145.00	0.42
52	300012	华测检测	161,900	2,413,929.00	0.42
53	002821	凯莱英	18,000	2,331,000.00	0.41
54	600291	西水股份	255,900	2,300,541.00	0.40
55	000025	特力A	100,600	2,132,720.00	0.37
56	002340	格林美	426,100	2,075,107.00	0.36
57	600801	华新水泥	75,600	1,998,108.00	0.35
58	000988	华工科技	98,300	1,994,507.00	0.35
59	002078	太阳纸业	201,000	1,977,840.00	0.34
60	002371	北方华创	22,400	1,971,200.00	0.34
61	000401	冀东水泥	115,400	1,962,954.00	0.34
62	000750	国海证券	360,388	1,924,471.92	0.34
63	300285	国瓷材料	82,300	1,880,555.00	0.33
64	002353	杰瑞股份	50,300	1,859,088.00	0.32
65	002926	华西证券	168,400	1,854,084.00	0.32
66	600415	小商品城	471,800	1,825,866.00	0.32
67	002195	二三四五	563,678	1,820,679.94	0.32
68	000598	兴蓉环境	388,600	1,799,218.00	0.31
69	600161	天坛生物	63,700	1,779,778.00	0.31

70	600642	申能股份	299,900	1,742,419.00	0.30
71	002500	山西证券	207,200	1,717,688.00	0.30
72	600312	平高电气	264,870	1,711,060.20	0.30
73	600582	天地科技	526,600	1,679,854.00	0.29
74	000997	新大陆	105,540	1,675,975.20	0.29
75	603650	彤程新材	95,800	1,668,836.00	0.29
76	000975	银泰黄金	121,142	1,648,742.62	0.29
77	002373	千方科技	91,000	1,641,640.00	0.29
78	600704	物产中大	309,800	1,626,450.00	0.28
79	600201	生物股份	85,900	1,608,048.00	0.28
80	601100	恒立液压	32,300	1,606,925.00	0.28
81	603444	吉比特	5,352	1,597,518.48	0.28
82	002387	维信诺	100,420	1,596,678.00	0.28
83	000686	东北证券	171,417	1,594,178.10	0.28
84	600446	金证股份	77,100	1,586,718.00	0.28
85	600879	航天电子	263,800	1,577,524.00	0.28
86	600584	长电科技	71,500	1,571,570.00	0.27
87	600079	人福医药	115,900	1,565,809.00	0.27
88	002013	中航机电	220,300	1,528,882.00	0.27
89	000999	华润三九	47,931	1,518,454.08	0.26
90	000513	丽珠集团	45,000	1,516,500.00	0.26
91	002444	巨星科技	141,200	1,516,488.00	0.26
92	002223	鱼跃医疗	73,400	1,491,488.00	0.26
93	603556	海兴电力	88,873	1,448,629.90	0.25
94	603939	益丰药房	19,600	1,435,112.00	0.25
95	300418	昆仑万维	84,100	1,408,675.00	0.25
96	000547	航天发展	137,200	1,402,184.00	0.24
97	600820	隧道股份	230,900	1,394,636.00	0.24
98	300058	蓝色光标	243,197	1,374,063.05	0.24
99	002110	三钢闽光	146,000	1,366,560.00	0.24
100	000581	威孚高科	71,705	1,365,980.25	0.24

101	600497	驰宏锌锗	310,800	1,361,304.00	0.24
102	601966	玲珑轮胎	58,700	1,345,991.00	0.23
103	300166	东方国信	103,500	1,345,500.00	0.23
104	000061	农产品	237,900	1,329,861.00	0.23
105	600881	亚泰集团	416,800	1,329,592.00	0.23
106	601005	重庆钢铁	718,000	1,328,300.00	0.23
107	002092	中泰化学	192,750	1,308,772.50	0.23
108	002690	美亚光电	32,900	1,286,390.00	0.22
109	601866	中远海发	485,400	1,257,186.00	0.22
110	000983	西山煤电	204,900	1,256,037.00	0.22
111	600779	水井坊	23,924	1,238,067.00	0.22
112	600875	东方电气	134,000	1,231,460.00	0.21
113	600959	江苏有线	306,150	1,218,477.00	0.21
114	600643	爱建集团	126,600	1,215,360.00	0.21
115	601016	节能风电	499,000	1,202,590.00	0.21
116	000402	金融街	146,300	1,187,956.00	0.21
117	600260	凯乐科技	86,240	1,170,276.80	0.20
118	600373	中文传媒	85,940	1,169,643.40	0.20
119	600967	内蒙一机	109,900	1,168,237.00	0.20
120	300009	安科生物	76,900	1,160,421.00	0.20
121	603882	金域医学	22,400	1,147,328.00	0.20
122	600094	大名城	195,000	1,140,750.00	0.20
123	000825	太钢不锈	278,800	1,140,292.00	0.20
124	002085	万丰奥威	160,600	1,124,200.00	0.20
125	000729	燕京啤酒	172,119	1,122,215.88	0.20
126	600282	南钢股份	325,200	1,121,940.00	0.20
127	600266	城建发展	138,100	1,118,610.00	0.20
128	600737	中粮糖业	130,900	1,107,414.00	0.19
129	002221	东华能源	141,300	1,096,488.00	0.19
130	603885	吉祥航空	72,227	1,083,405.00	0.19
131	600804	鹏博士	174,300	1,066,716.00	0.19

132	601699	潞安环能	146,400	1,062,864.00	0.19
133	600435	北方导航	127,600	1,061,632.00	0.19
134	601098	中南传媒	87,800	1,048,332.00	0.18
135	600777	新潮能源	498,300	1,046,430.00	0.18
136	600060	海信视像	96,100	1,042,685.00	0.18
137	600335	国机汽车	178,300	1,034,140.00	0.18
138	300244	迪安诊断	45,685	1,011,009.05	0.18
139	603816	顾家家居	22,100	1,010,633.00	0.18
140	600657	信达地产	251,426	1,003,189.74	0.17
141	600782	新钢股份	195,100	1,000,863.00	0.17
142	000883	湖北能源	238,944	996,396.48	0.17
143	000932	华菱钢铁	206,700	988,026.00	0.17
144	601106	中国一重	335,710	976,916.10	0.17
145	600863	内蒙华电	354,500	974,875.00	0.17
146	000738	航发控制	74,500	973,715.00	0.17
147	603228	景旺电子	22,100	968,422.00	0.17
148	002368	太极股份	24,800	965,216.00	0.17
149	600315	上海家化	31,000	959,140.00	0.17
150	002004	华邦健康	193,300	954,902.00	0.17
151	600597	光明乳业	74,700	947,943.00	0.17
152	002583	海能达	112,233	943,879.53	0.16
153	000060	中金岭南	219,500	943,850.00	0.16
154	000685	中山公用	113,269	933,336.56	0.16
155	600008	首创股份	278,302	915,613.58	0.16
156	300072	三聚环保	143,800	908,816.00	0.16
157	000559	万向钱潮	168,500	904,845.00	0.16
158	000027	深圳能源	145,620	904,300.20	0.16
159	603883	老百姓	14,078	902,118.24	0.16
160	601179	中国西电	245,543	893,776.52	0.16
161	600388	龙净环保	91,639	893,480.25	0.16
162	600729	重庆百货	29,900	892,515.00	0.16

163	600507	方大特钢	88,600	891,316.00	0.16
164	600039	四川路桥	265,100	890,736.00	0.16
165	600699	均胜电子	49,760	890,704.00	0.16
166	600970	中材国际	127,700	890,069.00	0.16
167	600908	无锡银行	158,300	878,565.00	0.15
168	601718	际华集团	267,900	873,354.00	0.15
169	000008	神州高铁	238,200	864,666.00	0.15
170	000012	南玻A	171,297	858,197.97	0.15
171	002831	裕同科技	32,200	854,910.00	0.15
172	600598	北大荒	87,057	847,935.18	0.15
173	001872	招商港口	49,200	844,272.00	0.15
174	600143	金发科技	115,000	837,200.00	0.15
175	002665	首航高科	248,100	833,616.00	0.15
176	000712	锦龙股份	54,800	832,960.00	0.15
177	000488	晨鸣纸业	163,535	832,393.15	0.15
178	600062	华润双鹤	63,600	829,980.00	0.14
179	600823	世茂股份	183,243	824,593.50	0.14
180	600563	法拉电子	16,500	815,925.00	0.14
181	000826	启迪环境	87,500	803,250.00	0.14
182	300257	开山股份	73,600	800,768.00	0.14
183	000400	许继电气	74,100	798,057.00	0.14
184	600862	中航高科	72,400	797,848.00	0.14
185	002002	鸿达兴业	189,600	788,736.00	0.14
186	002030	达安基因	68,268	785,082.00	0.14
187	002408	齐翔腾达	108,700	777,205.00	0.14
188	600717	天津港	123,020	772,565.60	0.13
189	002183	怡亚通	181,800	765,378.00	0.13
190	000301	东方盛虹	147,400	763,532.00	0.13
191	000078	海王生物	202,300	754,579.00	0.13
192	002244	滨江集团	152,300	749,316.00	0.13
193	000732	泰禾集团	121,800	749,070.00	0.13

194	600557	康缘药业	50,700	747,318.00	0.13
195	000681	视觉中国	42,900	739,596.00	0.13
196	002925	盈趣科技	16,800	738,360.00	0.13
197	600901	江苏租赁	116,600	736,912.00	0.13
198	002640	跨境通	95,000	733,400.00	0.13
199	000009	中国宝安	115,400	714,326.00	0.12
200	601928	凤凰传媒	93,563	712,014.43	0.12
201	600511	国药股份	25,563	697,614.27	0.12
202	002302	西部建设	61,700	696,593.00	0.12
203	603712	七一二	28,800	696,384.00	0.12
204	000813	德展健康	109,800	690,642.00	0.12
205	601611	中国核建	96,411	687,410.43	0.12
206	600316	洪都航空	52,535	684,531.05	0.12
207	603858	步长制药	33,100	682,522.00	0.12
208	002390	信邦制药	128,400	674,100.00	0.12
209	600499	科达洁能	154,400	668,552.00	0.12
210	600125	铁龙物流	111,488	666,698.24	0.12
211	600859	王府井	47,500	664,525.00	0.12
212	002839	张家港行	110,600	656,964.00	0.11
213	002250	联化科技	38,100	652,653.00	0.11
214	600575	淮河能源	252,800	649,696.00	0.11
215	000543	皖能电力	138,700	643,568.00	0.11
216	600565	迪马股份	178,900	640,462.00	0.11
217	002424	贵州百灵	73,400	639,314.00	0.11
218	600545	卓郎智能	104,100	631,887.00	0.11
219	002434	万里扬	65,700	622,836.00	0.11
220	601200	上海环境	55,800	619,380.00	0.11
221	002128	露天煤业	70,500	610,530.00	0.11
222	600126	杭钢股份	124,000	606,360.00	0.11
223	600317	营口港	237,700	606,135.00	0.11
224	002249	大洋电机	154,200	595,212.00	0.10

225	002051	中工国际	60,601	589,041.72	0.10
226	002815	崇达技术	33,600	580,944.00	0.10
227	300159	新研股份	145,900	571,928.00	0.10
228	002375	亚厦股份	98,400	570,720.00	0.10
229	000848	承德露露	71,600	563,492.00	0.10
230	600787	中储股份	107,844	561,867.24	0.10
231	000553	安道麦A	55,800	558,000.00	0.10
232	300115	长盈精密	31,100	553,269.00	0.10
233	000062	深圳华强	38,201	543,982.24	0.09
234	603888	新华网	25,400	535,940.00	0.09
235	600985	淮北矿业	53,264	532,107.36	0.09
236	000537	广宇发展	68,300	530,691.00	0.09
237	603568	伟明环保	23,000	527,620.00	0.09
238	000564	供销大集	220,600	527,234.00	0.09
239	603377	东方时尚	28,800	525,888.00	0.09
240	300297	蓝盾股份	91,800	517,752.00	0.09
241	002573	清新环境	79,400	512,130.00	0.09
242	603198	迎驾贡酒	24,800	494,016.00	0.09
243	002280	联络互动	124,907	483,390.09	0.08
244	002625	光启技术	52,700	482,205.00	0.08
245	600623	华谊集团	72,500	482,125.00	0.08
246	600329	中新药业	34,600	479,556.00	0.08
247	000869	张裕A	16,600	476,420.00	0.08
248	000937	冀中能源	129,700	474,702.00	0.08
249	002382	蓝帆医疗	39,000	473,460.00	0.08
250	603766	隆鑫通用	125,700	468,861.00	0.08
251	000778	新兴铸管	107,100	446,607.00	0.08
252	600639	浦东金桥	32,800	442,800.00	0.08
253	600098	广州发展	66,800	436,872.00	0.08
254	000980	众泰汽车	148,900	436,277.00	0.08
255	000600	建投能源	87,471	427,733.19	0.07

256	002505	大康农业	243,300	425,775.00	0.07
257	600350	山东高速	86,300	423,733.00	0.07
258	600058	五矿发展	52,500	421,050.00	0.07
259	600138	中青旅	33,300	419,580.00	0.07
260	601615	明阳智能	33,600	413,280.00	0.07
261	600428	中远海特	110,120	411,848.80	0.07
262	600755	厦门国贸	55,600	408,104.00	0.07
263	002653	海思科	19,900	405,164.00	0.07
264	600874	创业环保	55,700	400,483.00	0.07
265	601801	皖新传媒	73,000	400,040.00	0.07
266	601127	小康股份	34,600	394,440.00	0.07
267	600053	九鼎投资	15,200	386,536.00	0.07
268	600120	浙江东方	44,236	386,180.28	0.07
269	002818	富森美	29,600	374,440.00	0.07
270	603866	桃李面包	8,743	371,052.92	0.06
271	601869	长飞光纤	10,100	333,603.00	0.06
272	600996	贵广网络	38,500	309,925.00	0.05
273	601811	新华文轩	20,600	271,714.00	0.05
274	603225	新凤鸣	21,644	267,303.40	0.05
275	600307	酒钢宏兴	109,600	225,776.00	0.04
276	601068	中铝国际	40,000	221,600.00	0.04
277	600939	重庆建工	44,400	213,564.00	0.04
278	000758	中色股份	43,700	191,406.00	0.03
279	002603	以岭药业	14,600	181,478.00	0.03
280	600728	佳都科技	15,719	147,444.22	0.03
281	601118	海南橡胶	28,600	140,712.00	0.02
282	000718	苏宁环球	35,500	135,610.00	0.02
283	603877	太平鸟	7,000	106,890.00	0.02
284	600348	阳泉煤业	13,900	76,867.00	0.01
285	603517	绝味食品	1,447	67,213.15	0.01
286	600325	华发股份	7,700	60,291.00	0.01

287	002118	紫鑫药业	6,200	38,688.00	0.01
288	002203	海亮股份	1,700	17,425.00	0.00
289	603338	浙江鼎力	100	7,150.00	0.00
290	600645	中源协和	100	1,693.00	0.00
291	002074	国轩高科	42	611.10	0.00
292	600707	彩虹股份	19	79.80	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300196	长海股份	329,100	3,810,978.00	0.66
2	000661	长春高新	8,315	3,716,805.00	0.65
3	603986	兆易创新	18,100	3,708,509.00	0.65
4	603916	苏博特	219,600	3,706,848.00	0.65
5	601898	中煤能源	737,429	3,701,893.58	0.65
6	000768	中航飞机	224,100	3,670,758.00	0.64
7	600887	伊利股份	117,900	3,647,826.00	0.64
8	601186	中国铁建	355,500	3,604,770.00	0.63
9	300709	精研科技	36,100	3,525,165.00	0.61
10	002475	立讯精密	96,400	3,518,600.00	0.61
11	601319	中国人保	460,149	3,492,530.91	0.61
12	603003	龙宇燃油	423,300	3,437,196.00	0.60
13	300560	中富通	192,580	3,023,506.00	0.53
14	002616	长青集团	307,968	2,519,178.24	0.44
15	300347	泰格医药	39,830	2,515,264.50	0.44
16	300397	天和防务	84,800	2,502,448.00	0.44
17	603358	华达科技	158,320	2,341,552.80	0.41

18	002241	歌尔股份	115,100	2,292,792.00	0.40
19	002236	大华股份	115,186	2,289,897.68	0.40
20	600188	兖州煤业	207,400	2,190,144.00	0.38
21	002632	道明光学	292,000	2,157,880.00	0.38
22	600406	国电南瑞	97,708	2,069,455.44	0.36
23	300487	蓝晓科技	52,000	1,898,000.00	0.33
24	002600	领益智造	168,400	1,827,140.00	0.32
25	603277	银都股份	165,547	1,777,974.78	0.31
26	601028	玉龙股份	292,600	1,495,186.00	0.26
27	603729	龙韵股份	92,400	1,469,160.00	0.26
28	603661	恒林股份	32,892	1,445,274.48	0.25
29	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.24
30	603901	永创智能	119,600	1,272,544.00	0.22
31	688188	柏楚电子	7,847	1,193,450.23	0.21
32	300559	佳发教育	33,600	984,480.00	0.17
33	000876	新希望	45,100	899,745.00	0.16
34	002846	英联股份	45,100	847,880.00	0.15
35	002318	久立特材	88,500	830,130.00	0.14
36	002940	昂利康	27,600	825,792.00	0.14
37	300571	平治信息	12,000	658,560.00	0.11
38	002620	瑞和股份	102,900	628,719.00	0.11
39	000166	申万宏源	122,700	628,224.00	0.11
40	300059	东方财富	31,800	501,486.00	0.09
41	603633	徕木股份	46,200	474,474.00	0.08
42	002608	江苏国信	53,400	411,714.00	0.07
43	002555	三七互娱	8,300	223,519.00	0.04
44	688299	长阳科技	11,341	178,507.34	0.03
45	688138	清溢光电	10,066	139,816.74	0.02
46	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.02
47	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
48	300291	华录百纳	10,300	62,212.00	0.01

49	002921	联诚精密	3,000	55,080.00	0.01
50	300320	海达股份	9,000	43,740.00	0.01
51	002972	科安达	1,075	21,532.25	-
52	603109	神驰机电	684	18,105.48	-
53	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	-
54	300546	雄帝科技	100	2,891.00	-
55	603869	新智认知	28	333.76	-
56	002641	永高股份	68	317.56	-
57	300645	正元智慧	10	145.50	-
58	603167	渤海轮渡	11	118.69	-

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600426	华鲁恒升	26,399,485.00	9.75
2	000581	威孚高科	19,751,526.55	7.29
3	600827	百联股份	19,712,816.95	7.28
4	002299	圣农发展	19,062,897.20	7.04
5	002465	海格通信	19,040,467.64	7.03
6	600183	生益科技	18,858,749.73	6.96
7	600739	辽宁成大	18,598,183.47	6.87
8	000028	国药一致	18,364,384.04	6.78
9	600056	中国医药	18,114,862.54	6.69
10	600201	生物股份	18,008,292.00	6.65
11	300182	捷成股份	17,723,241.62	6.55
12	600959	江苏有线	17,614,219.99	6.51
13	000686	东北证券	17,397,154.64	6.43
14	600410	华胜天成	16,704,792.60	6.17
15	600376	首开股份	16,612,614.97	6.14

16	601872	招商轮船	16,508,984.80	6.10
17	000690	宝新能源	16,212,148.72	5.99
18	002358	森源电气	15,960,512.00	5.89
19	600325	华发股份	15,924,157.96	5.88
20	002129	中环股份	15,873,820.00	5.86
21	600312	平高电气	15,718,789.71	5.81
22	002092	中泰化学	15,651,758.91	5.78
23	002463	沪电股份	15,647,472.00	5.78
24	002048	宁波华翔	15,240,472.20	5.63
25	601000	唐山港	15,025,543.88	5.55
26	002371	北方华创	14,991,798.53	5.54
27	600373	中文传媒	14,871,838.32	5.49
28	600879	航天电子	14,686,408.00	5.42
29	600642	申能股份	14,224,351.48	5.25
30	600737	中粮糖业	14,063,480.00	5.19
31	600062	华润双鹤	14,019,269.09	5.18
32	600801	华新水泥	13,935,853.14	5.15
33	002078	太阳纸业	13,855,564.88	5.12
34	000685	中山公用	13,779,024.32	5.09
35	300316	晶盛机电	13,738,029.70	5.07
36	600169	太原重工	13,736,588.00	5.07
37	002440	闰土股份	13,671,415.06	5.05
38	000997	新大陆	13,670,557.40	5.05
39	600348	阳泉煤业	13,645,560.00	5.04
40	600266	城建发展	13,577,550.60	5.01
41	600329	中新药业	13,461,401.95	4.97
42	000860	顺鑫农业	13,428,775.40	4.96
43	600633	浙数文化	13,372,694.55	4.94
44	600466	蓝光发展	13,338,317.60	4.93
45	600884	杉杉股份	13,247,999.34	4.89
46	603556	海兴电力	13,219,973.44	4.88

47	300315	掌趣科技	13,174,254.00	4.87
48	600779	水井坊	13,166,963.98	4.86
49	002384	东山精密	13,112,966.00	4.84
50	600315	上海家化	13,054,876.00	4.82
51	600645	中源协和	13,045,825.00	4.82
52	002640	跨境通	12,982,090.00	4.79
53	600037	歌华有线	12,977,928.68	4.79
54	601100	恒立液压	12,928,238.77	4.77
55	600073	上海梅林	12,886,022.56	4.76
56	000960	锡业股份	12,623,860.71	4.66
57	600835	上海机电	12,618,565.00	4.66
58	002152	广电运通	12,588,692.00	4.65
59	000513	丽珠集团	12,580,249.13	4.65
60	600160	巨化股份	12,562,730.00	4.64
61	002439	启明星辰	12,516,355.82	4.62
62	002500	山西证券	12,497,422.44	4.62
63	000778	新兴铸管	12,486,340.63	4.61
64	600409	三友化工	12,463,875.00	4.60
65	000559	万向钱潮	12,426,050.76	4.59
66	002745	木林森	12,408,600.20	4.58
67	600500	中化国际	12,386,254.80	4.57
68	300002	神州泰岳	12,369,381.94	4.57
69	000932	华菱钢铁	12,363,150.20	4.57
70	300166	东方国信	12,349,343.24	4.56
71	600673	东阳光	12,340,373.04	4.56
72	002583	海能达	12,249,175.20	4.52
73	600782	新钢股份	12,224,479.08	4.51
74	600021	上海电力	12,216,573.62	4.51
75	000060	中金岭南	12,198,388.00	4.51
76	002353	杰瑞股份	12,198,221.82	4.50
77	600256	广汇能源	12,142,147.00	4.48

78	600611	大众交通	12,050,986.79	4.45
79	600125	铁龙物流	11,986,642.72	4.43
80	300001	特锐德	11,981,733.00	4.43
81	600557	康缘药业	11,955,815.72	4.42
82	601098	中南传媒	11,900,993.88	4.40
83	600499	科达洁能	11,843,698.00	4.37
84	600643	爱建集团	11,822,964.88	4.37
85	600380	健康元	11,801,201.00	4.36
86	002399	海普瑞	11,758,151.00	4.34
87	300058	蓝色光标	11,756,463.16	4.34
88	000999	华润三九	11,705,862.76	4.32
89	300146	汤臣倍健	11,646,767.39	4.30
90	600718	东软集团	11,636,998.11	4.30
91	600881	亚泰集团	11,633,779.97	4.30
92	002081	金螳螂	11,580,122.00	4.28
93	000738	航发控制	11,538,126.00	4.26
94	600885	宏发股份	11,516,625.98	4.25
95	600567	山鹰纸业	11,404,860.57	4.21
96	600079	人福医药	11,401,848.00	4.21
97	000031	大悦城	11,392,521.63	4.21
98	603866	桃李面包	11,375,705.14	4.20
99	600507	方大特钢	11,372,763.12	4.20
100	600161	天坛生物	11,314,144.00	4.18
101	002217	合力泰	11,296,455.04	4.17
102	000598	兴蓉环境	11,261,261.00	4.16
103	300274	阳光电源	11,257,448.89	4.16
104	600031	三一重工	11,234,285.00	4.15
105	002233	塔牌集团	11,228,242.13	4.15
106	600970	中材国际	11,170,064.00	4.13
107	600572	康恩贝	11,148,408.69	4.12
108	600999	招商证券	11,053,793.87	4.08

109	002195	二三四五	11,049,884.20	4.08
110	600026	中远海能	11,029,376.18	4.07
111	000543	皖能电力	10,979,280.00	4.05
112	000027	深圳能源	10,977,156.56	4.05
113	000723	美锦能源	10,966,157.00	4.05
114	603885	吉祥航空	10,864,852.57	4.01
115	601005	重庆钢铁	10,845,489.00	4.01
116	002004	华邦健康	10,759,027.00	3.97
117	600282	南钢股份	10,666,013.00	3.94
118	002019	亿帆医药	10,653,610.98	3.93
119	600511	国药股份	10,645,888.58	3.93
120	600260	凯乐科技	10,617,983.60	3.92
121	601168	西部矿业	10,589,982.54	3.91
122	600859	王府井	10,499,528.84	3.88
123	000066	中国长城	10,489,406.20	3.87
124	002028	思源电气	10,464,865.26	3.86
125	002603	以岭药业	10,410,255.00	3.84
126	300133	华策影视	10,367,399.43	3.83
127	000039	中集集团	10,367,215.98	3.83
128	601019	山东出版	10,356,822.49	3.82
129	000980	众泰汽车	10,306,065.00	3.81
130	600765	中航重机	10,273,312.15	3.79
131	600277	亿利洁能	10,235,302.91	3.78
132	002544	杰赛科技	10,183,030.87	3.76
133	300088	长信科技	10,156,407.00	3.75
134	300383	光环新网	10,013,829.00	3.70
135	000401	冀东水泥	9,996,814.00	3.69
136	000156	华数传媒	9,943,637.00	3.67
137	600745	闻泰科技	9,931,417.00	3.67
138	601231	环旭电子	9,921,534.00	3.66
139	002191	劲嘉股份	9,919,029.00	3.66

140	000718	苏宁环球	9,885,502.33	3.65
141	000547	航天发展	9,872,431.88	3.65
142	600754	锦江酒店	9,865,309.10	3.64
143	000987	越秀金控	9,822,071.74	3.63
144	600126	杭钢股份	9,800,692.27	3.62
145	002410	广联达	9,775,243.28	3.61
146	603369	今世缘	9,771,779.00	3.61
147	000488	晨鸣纸业	9,769,459.83	3.61
148	601966	玲珑轮胎	9,761,105.44	3.60
149	300253	卫宁健康	9,668,293.37	3.57
150	600563	法拉电子	9,659,746.42	3.57
151	600699	均胜电子	9,654,972.20	3.57
152	603816	顾家家居	9,637,492.21	3.56
153	000078	海王生物	9,625,986.00	3.56
154	600862	中航高科	9,622,459.00	3.55
155	000012	南玻A	9,614,168.69	3.55
156	002074	国轩高科	9,601,049.08	3.55
157	300297	蓝盾股份	9,570,862.00	3.53
158	002244	滨江集团	9,547,201.00	3.53
159	000877	天山股份	9,497,409.00	3.51
160	600967	内蒙一机	9,465,301.66	3.50
161	600808	马钢股份	9,462,948.00	3.49
162	000009	中国宝安	9,458,870.46	3.49
163	002635	安洁科技	9,456,836.00	3.49
164	600151	航天机电	9,434,669.86	3.48
165	000528	柳工	9,382,144.80	3.46
166	601958	金钼股份	9,322,520.00	3.44
167	600863	内蒙华电	9,302,977.55	3.44
168	000758	中色股份	9,253,671.00	3.42
169	002223	鱼跃医疗	9,241,392.00	3.41
170	002065	东华软件	9,240,688.00	3.41

171	002221	东华能源	9,183,462.30	3.39
172	000090	天健集团	9,178,643.70	3.39
173	600820	隧道股份	9,144,259.54	3.38
174	000623	吉林敖东	9,128,244.30	3.37
175	600872	中炬高新	9,110,445.00	3.36
176	000830	鲁西化工	9,099,706.00	3.36
177	000848	承德露露	9,096,895.73	3.36
178	300010	立思辰	9,093,079.63	3.36
179	601866	中远海发	9,079,230.00	3.35
180	601615	明阳智能	9,071,950.45	3.35
181	300055	万邦达	9,048,464.00	3.34
182	601003	柳钢股份	9,014,931.40	3.33
183	002049	紫光国微	8,994,213.11	3.32
184	601179	中国西电	8,884,324.11	3.28
185	600623	华谊集团	8,859,645.00	3.27
186	600565	迪马股份	8,831,933.00	3.26
187	002273	水晶光电	8,829,164.00	3.26
188	600598	北大荒	8,796,493.63	3.25
189	600755	厦门国贸	8,743,762.00	3.23
190	000813	德展健康	8,672,349.75	3.20
191	603077	和邦生物	8,670,508.40	3.20
192	000157	中联重科	8,655,477.00	3.20
193	002332	仙琚制药	8,642,036.83	3.19
194	601718	际华集团	8,622,418.00	3.18
195	600388	龙净环保	8,621,005.65	3.18
196	600536	中国软件	8,609,739.00	3.18
197	600166	福田汽车	8,604,753.00	3.18
198	300450	先导智能	8,531,417.00	3.15
199	000061	农产品	8,509,333.66	3.14
200	002373	千方科技	8,493,692.00	3.14
201	300413	芒果超媒	8,491,083.06	3.14

202	002317	众生药业	8,478,471.69	3.13
203	000600	建投能源	8,427,343.50	3.11
204	603198	迎驾贡酒	8,424,834.04	3.11
205	002013	中航机电	8,404,049.50	3.10
206	002174	游族网络	8,385,217.45	3.10
207	002157	正邦科技	8,373,076.00	3.09
208	600750	江中药业	8,314,042.33	3.07
209	600597	光明乳业	8,283,456.00	3.06
210	000878	云南铜业	8,275,414.72	3.06
211	002030	达安基因	8,261,469.90	3.05
212	600875	东方电气	8,258,764.02	3.05
213	600804	鹏博士	8,258,238.99	3.05
214	002280	联络互动	8,249,957.87	3.05
215	603501	韦尔股份	8,249,682.32	3.05
216	002408	齐翔腾达	8,227,739.66	3.04
217	300459	金科文化	8,227,719.58	3.04
218	000988	华工科技	8,212,502.00	3.03
219	600729	重庆百货	8,197,165.42	3.03
220	300026	红日药业	8,140,794.00	3.01
221	601717	郑煤机	8,111,426.00	3.00
222	000930	中粮科技	8,107,285.00	2.99
223	002128	露天煤业	8,062,707.62	2.98
224	600839	四川长虹	8,049,443.41	2.97
225	600138	中青旅	8,033,262.59	2.97
226	000400	许继电气	8,026,644.00	2.96
227	002385	大北农	8,018,042.00	2.96
228	603806	福斯特	7,966,078.07	2.94
229	600291	西水股份	7,857,085.63	2.90
230	002491	通鼎互联	7,839,193.85	2.90
231	000537	广宇发展	7,782,280.77	2.87
232	000501	鄂武商 A	7,764,417.00	2.87

233	002242	九阳股份	7,746,207.00	2.86
234	603444	吉比特	7,740,392.80	2.86
235	002127	南极电商	7,731,963.20	2.86
236	600580	卧龙电驱	7,722,355.85	2.85
237	000975	银泰黄金	7,720,246.64	2.85
238	600060	海信视像	7,696,034.00	2.84
239	000807	云铝股份	7,677,292.10	2.84
240	600258	首旅酒店	7,665,998.00	2.83
241	600155	华创阳安	7,656,010.00	2.83
242	002600	领益智造	7,619,821.00	2.81
243	600098	广州发展	7,618,791.00	2.81
244	002051	中工国际	7,612,963.11	2.81
245	601233	桐昆股份	7,603,553.20	2.81
246	002236	大华股份	7,593,624.06	2.80
247	002573	清新环境	7,575,635.00	2.80
248	300287	飞利信	7,572,452.00	2.80
249	600664	哈药股份	7,553,748.56	2.79
250	000750	国海证券	7,518,137.82	2.78
251	002815	崇达技术	7,510,328.68	2.77
252	600582	天地科技	7,456,367.00	2.75
253	600649	城投控股	7,447,296.56	2.75
254	601699	潞安环能	7,442,988.10	2.75
255	601668	中国建筑	7,438,379.00	2.75
256	300360	炬华科技	7,437,471.18	2.75
257	600600	青岛啤酒	7,432,003.24	2.74
258	002340	格林美	7,408,060.38	2.74
259	002701	奥瑞金	7,406,842.00	2.74
260	600094	大名城	7,404,413.11	2.73
261	600497	驰宏锌锗	7,399,432.53	2.73
262	603228	景旺电子	7,335,333.21	2.71
263	002414	高德红外	7,306,442.07	2.70

264	300367	东方网力	7,284,508.63	2.69
265	600338	西藏珠峰	7,231,928.24	2.67
266	600039	四川路桥	7,165,256.00	2.65
267	000887	中鼎股份	7,163,658.00	2.65
268	000596	古井贡酒	7,143,019.50	2.64
269	002085	万丰奥威	7,117,134.00	2.63
270	000021	深科技	7,103,056.01	2.62
271	000656	金科股份	7,094,152.00	2.62
272	002831	裕同科技	7,053,906.80	2.61
273	603025	大豪科技	7,029,364.58	2.60
274	300418	昆仑万维	7,009,713.00	2.59
275	603869	新智认知	7,005,750.55	2.59
276	300347	泰格医药	6,976,788.70	2.58
277	300134	大富科技	6,957,603.50	2.57
278	000301	东方盛虹	6,862,137.00	2.53
279	601607	上海医药	6,848,392.00	2.53
280	603688	石英股份	6,838,463.68	2.53
281	600418	江淮汽车	6,822,096.86	2.52
282	002183	怡亚通	6,816,213.98	2.52
283	601225	陕西煤业	6,748,632.00	2.49
284	000829	天音控股	6,742,458.20	2.49
285	002507	涪陵榨菜	6,715,307.64	2.48
286	002468	申通快递	6,694,446.00	2.47
287	600519	贵州茅台	6,618,832.00	2.44
288	600694	大商股份	6,586,900.00	2.43
289	603877	太平鸟	6,570,844.00	2.43
290	600143	金发科技	6,560,932.00	2.42
291	600845	宝信软件	6,533,883.60	2.41
292	002131	利欧股份	6,515,789.00	2.41
293	002368	太极股份	6,513,167.00	2.41
294	300115	长盈精密	6,511,724.00	2.40

295	600823	世茂股份	6,493,908.62	2.40
296	000883	湖北能源	6,485,079.56	2.40
297	603000	人民网	6,469,042.32	2.39
298	600017	日照港	6,451,560.74	2.38
299	600195	中牧股份	6,440,026.97	2.38
300	601689	拓普集团	6,421,425.85	2.37
301	000069	华侨城 A	6,414,850.00	2.37
302	600887	伊利股份	6,386,461.65	2.36
303	601211	国泰君安	6,363,756.00	2.35
304	002212	南洋股份	6,310,464.30	2.33
305	002180	纳思达	6,288,303.22	2.32
306	600895	张江高科	6,286,506.00	2.32
307	600188	兖州煤业	6,281,907.00	2.32
308	600307	酒钢宏兴	6,279,296.00	2.32
309	600717	天津港	6,276,276.77	2.32
310	603328	依顿电子	6,234,203.48	2.30
311	000519	中兵红箭	6,231,477.43	2.30
312	600886	国投电力	6,229,434.25	2.30
313	600267	海正药业	6,216,395.00	2.30
314	601128	常熟银行	6,210,882.03	2.29
315	601106	中国一重	6,178,910.10	2.28
316	600704	物产中大	6,176,601.00	2.28
317	002475	立讯精密	6,169,553.00	2.28
318	600787	中储股份	6,161,877.39	2.28
319	300257	开山股份	6,143,636.00	2.27
320	002690	美亚光电	6,118,544.00	2.26
321	300196	长海股份	6,095,428.00	2.25
322	300244	迪安诊断	6,093,959.60	2.25
323	002281	光迅科技	6,078,102.04	2.24
324	600064	南京高科	6,035,133.00	2.23
325	600486	扬农化工	5,989,568.00	2.21

326	601001	大同煤业	5,948,884.06	2.20
327	600585	海螺水泥	5,938,540.12	2.19
328	601111	中国国航	5,918,531.00	2.19
329	000552	靖远煤电	5,910,937.00	2.18
330	000869	张裕A	5,909,227.84	2.18
331	000541	佛山照明	5,883,987.40	2.17
332	601020	华钰矿业	5,882,110.13	2.17
333	000006	深振业A	5,853,019.00	2.16
334	600971	恒源煤电	5,835,020.40	2.15
335	000158	常山北明	5,813,214.84	2.15
336	000990	诚志股份	5,811,820.00	2.15
337	600848	上海临港	5,780,567.70	2.13
338	002400	省广集团	5,779,430.00	2.13
339	601928	凤凰传媒	5,754,724.96	2.13
340	300291	华录百纳	5,752,095.00	2.12
341	600496	精工钢构	5,736,020.00	2.12
342	002541	鸿路钢构	5,735,606.00	2.12
343	000636	风华高科	5,729,938.00	2.12
344	300207	欣旺达	5,726,739.00	2.11
345	300219	鸿利智汇	5,719,470.62	2.11
346	002372	伟星新材	5,710,822.08	2.11
347	002064	华峰氨纶	5,688,390.00	2.10
348	002277	友阿股份	5,611,508.00	2.07
349	300502	新易盛	5,579,117.00	2.06
350	600908	无锡银行	5,576,430.00	2.06
351	600316	洪都航空	5,557,010.01	2.05
352	600350	山东高速	5,547,287.32	2.05
353	002007	华兰生物	5,538,114.69	2.05
354	000651	格力电器	5,535,920.12	2.04
355	002434	万里扬	5,531,896.00	2.04
356	603899	晨光文具	5,531,530.57	2.04

357	600993	马应龙	5,524,770.58	2.04
358	600584	长电科技	5,515,955.00	2.04
359	600594	益佰制药	5,468,417.00	2.02
360	300113	顺网科技	5,457,786.00	2.02
361	600901	江苏租赁	5,428,979.00	2.01
362	600383	金地集团	5,426,833.34	2.00

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	23,475,341.90	8.67
2	002299	圣农发展	20,782,677.78	7.68
3	000581	威孚高科	20,120,464.70	7.43
4	600183	生益科技	19,951,182.14	7.37
5	601872	招商轮船	18,723,188.99	6.91
6	600201	生物股份	18,593,883.51	6.87
7	002465	海格通信	18,306,201.40	6.76
8	000686	东北证券	17,614,429.00	6.51
9	600410	华胜天成	17,585,406.50	6.49
10	000690	宝新能源	16,738,347.00	6.18
11	600325	华发股份	16,342,247.00	6.04
12	600959	江苏有线	16,087,513.44	5.94
13	600879	航天电子	15,325,159.91	5.66
14	000028	国药一致	15,216,353.85	5.62
15	002129	中环股份	15,175,008.00	5.60
16	600827	百联股份	15,095,470.37	5.57
17	600633	浙数文化	14,794,001.95	5.46
18	600373	中文传媒	14,741,692.68	5.44
19	000860	顺鑫农业	14,725,050.48	5.44

20	002152	广电运通	14,722,692.52	5.44
21	002092	中泰化学	14,711,889.39	5.43
22	600737	中粮糖业	14,533,478.00	5.37
23	600642	申能股份	14,522,872.95	5.36
24	300315	掌趣科技	14,481,055.00	5.35
25	002640	跨境通	14,419,984.00	5.33
26	600160	巨化股份	14,394,290.61	5.32
27	000685	中山公用	14,288,719.76	5.28
28	600348	阳泉煤业	14,206,208.00	5.25
29	600056	中国医药	14,199,713.96	5.24
30	000997	新大陆	13,945,279.80	5.15
31	002078	太阳纸业	13,880,543.48	5.13
32	002371	北方华创	13,856,631.32	5.12
33	600266	城建发展	13,825,175.39	5.11
34	002463	沪电股份	13,806,584.00	5.10
35	600256	广汇能源	13,782,146.90	5.09
36	600466	蓝光发展	13,755,661.40	5.08
37	600169	太原重工	13,706,031.13	5.06
38	600801	华新水泥	13,644,492.24	5.04
39	600312	平高电气	13,622,600.68	5.03
40	600739	辽宁成大	13,558,609.00	5.01
41	600073	上海梅林	13,539,710.72	5.00
42	600500	中化国际	13,462,385.60	4.97
43	600884	杉杉股份	13,358,307.66	4.93
44	600062	华润双鹤	13,339,170.88	4.93
45	300146	汤臣倍健	13,291,976.52	4.91
46	600380	健康元	13,231,416.69	4.89
47	600835	上海机电	13,072,863.29	4.83
48	600611	大众交通	12,946,855.02	4.78
49	600376	首开股份	12,933,865.85	4.78
50	000778	新兴铸管	12,862,075.51	4.75

51	000060	中金岭南	12,857,064.64	4.75
52	600673	东阳光	12,797,760.34	4.73
53	600557	康缘药业	12,719,705.26	4.70
54	600567	山鹰纸业	12,689,295.60	4.69
55	002048	宁波华翔	12,683,795.22	4.68
56	600645	中源协和	12,681,891.82	4.68
57	603556	海兴电力	12,679,392.86	4.68
58	300182	捷成股份	12,678,379.60	4.68
59	600315	上海家化	12,535,269.62	4.63
60	600409	三友化工	12,486,560.41	4.61
61	600031	三一重工	12,475,950.80	4.61
62	601168	西部矿业	12,464,097.00	4.60
63	600329	中新药业	12,413,057.97	4.58
64	600021	上海电力	12,404,848.03	4.58
65	600765	中航重机	12,265,103.93	4.53
66	300088	长信科技	12,232,273.00	4.52
67	600779	水井坊	12,167,650.15	4.49
68	600885	宏发股份	12,081,499.94	4.46
69	600572	康恩贝	12,054,148.95	4.45
70	002583	海能达	11,930,611.00	4.41
71	600782	新钢股份	11,923,356.88	4.40
72	000999	华润三九	11,906,472.85	4.40
73	600718	东软集团	11,869,326.10	4.38
74	000513	丽珠集团	11,853,806.87	4.38
75	300166	东方国信	11,849,651.97	4.38
76	002500	山西证券	11,845,311.00	4.37
77	600499	科达洁能	11,825,691.00	4.37
78	300383	光环新网	11,788,503.58	4.35
79	600507	方大特钢	11,774,842.61	4.35
80	002358	森源电气	11,767,711.63	4.35
81	300001	特锐德	11,765,182.00	4.35

82	002399	海普瑞	11,748,019.92	4.34
83	300274	阳光电源	11,715,501.00	4.33
84	000039	中集集团	11,696,981.29	4.32
85	600999	招商证券	11,692,197.46	4.32
86	601231	环旭电子	11,632,350.00	4.30
87	601098	中南传媒	11,609,658.00	4.29
88	601100	恒立液压	11,580,760.23	4.28
89	600026	中远海能	11,541,878.00	4.26
90	600881	亚泰集团	11,510,247.30	4.25
91	002019	亿帆医药	11,499,146.00	4.25
92	002353	杰瑞股份	11,479,974.44	4.24
93	002233	塔牌集团	11,411,607.00	4.21
94	600079	人福医药	11,359,496.59	4.20
95	300058	蓝色光标	11,348,228.07	4.19
96	000156	华数传媒	11,329,658.68	4.18
97	002410	广联达	11,258,266.00	4.16
98	603866	桃李面包	11,215,743.85	4.14
99	000559	万向钱潮	11,213,175.63	4.14
100	000932	华菱钢铁	11,209,623.00	4.14
101	600125	铁龙物流	11,129,632.46	4.11
102	000598	兴蓉环境	11,054,174.00	4.08
103	002195	二三四五	11,009,347.03	4.07
104	603369	今世缘	10,987,720.38	4.06
105	002081	金螳螂	10,972,426.00	4.05
106	600643	爱建集团	10,954,809.36	4.05
107	002004	华邦健康	10,903,044.79	4.03
108	600161	天坛生物	10,824,735.93	4.00
109	002384	东山精密	10,814,681.00	3.99
110	600970	中材国际	10,720,577.50	3.96
111	600277	亿利洁能	10,712,307.34	3.96
112	000009	中国宝安	10,695,834.36	3.95

113	000738	航发控制	10,662,871.80	3.94
114	600511	国药股份	10,627,296.38	3.92
115	000488	晨鸣纸业	10,486,904.26	3.87
116	600872	中炬高新	10,459,827.53	3.86
117	603885	吉祥航空	10,459,397.20	3.86
118	600260	凯乐科技	10,417,416.73	3.85
119	601000	唐山港	10,405,803.00	3.84
120	002191	劲嘉股份	10,405,620.66	3.84
121	002440	闰土股份	10,358,872.00	3.83
122	000027	深圳能源	10,316,525.38	3.81
123	002603	以岭药业	10,316,110.23	3.81
124	000980	众泰汽车	10,297,628.82	3.80
125	002745	木林森	10,238,416.20	3.78
126	600754	锦江酒店	10,194,283.00	3.76
127	000718	苏宁环球	10,140,473.00	3.75
128	000543	皖能电力	10,129,247.00	3.74
129	000723	美锦能源	10,091,091.00	3.73
130	000547	航天发展	10,089,924.67	3.73
131	002074	国轩高科	10,064,199.60	3.72
132	600282	南钢股份	10,044,467.00	3.71
133	300133	华策影视	10,023,047.00	3.70
134	002244	滨江集团	9,931,229.00	3.67
135	601005	重庆钢铁	9,900,511.00	3.66
136	600699	均胜电子	9,872,232.40	3.65
137	000078	海王生物	9,870,572.97	3.65
138	000878	云南铜业	9,821,227.52	3.63
139	600808	马钢股份	9,817,402.00	3.63
140	600126	杭钢股份	9,814,639.12	3.62
141	002317	众生药业	9,792,651.00	3.62
142	300010	立思辰	9,786,872.00	3.61
143	002635	安洁科技	9,747,029.00	3.60

144	300316	晶盛机电	9,642,637.85	3.56
145	601966	玲珑轮胎	9,628,028.20	3.56
146	002332	仙琚制药	9,627,630.76	3.56
147	000758	中色股份	9,624,985.00	3.55
148	002273	水晶光电	9,616,934.00	3.55
149	600859	王府井	9,604,990.34	3.55
150	000830	鲁西化工	9,582,554.64	3.54
151	600745	闻泰科技	9,570,730.76	3.53
152	000848	承德露露	9,559,516.60	3.53
153	300450	先导智能	9,554,792.15	3.53
154	000012	南玻 A	9,540,590.03	3.52
155	300413	芒果超媒	9,534,180.23	3.52
156	600037	歌华有线	9,487,865.33	3.50
157	000157	中联重科	9,482,984.67	3.50
158	601003	柳钢股份	9,476,108.00	3.50
159	600536	中国软件	9,459,520.60	3.49
160	000528	柳工	9,411,217.65	3.48
161	600967	内蒙一机	9,408,109.00	3.47
162	600151	航天机电	9,394,926.56	3.47
163	603501	韦尔股份	9,325,900.92	3.44
164	600580	卧龙电驱	9,297,553.70	3.43
165	600563	法拉电子	9,291,330.50	3.43
166	000090	天健集团	9,279,997.00	3.43
167	000021	深科技	9,271,838.62	3.42
168	600862	中航高科	9,251,495.00	3.42
169	300297	蓝盾股份	9,197,465.64	3.40
170	603198	迎驾贡酒	9,173,099.71	3.39
171	600750	江中药业	9,159,894.07	3.38
172	000401	冀东水泥	9,158,900.00	3.38
173	601717	郑煤机	9,124,154.42	3.37
174	300055	万邦达	9,109,953.12	3.36

175	600565	迪马股份	9,064,492.00	3.35
176	600863	内蒙华电	9,063,729.50	3.35
177	300026	红日药业	8,999,019.00	3.32
178	600623	华谊集团	8,991,497.55	3.32
179	600839	四川长虹	8,977,506.06	3.32
180	603077	和邦生物	8,960,474.00	3.31
181	002030	达安基因	8,934,456.57	3.30
182	601179	中国西电	8,932,706.58	3.30
183	002280	联络互动	8,917,923.00	3.29
184	000960	锡业股份	8,837,747.18	3.26
185	601866	中远海发	8,819,083.00	3.26
186	601615	明阳智能	8,818,386.32	3.26
187	000501	鄂武商 A	8,795,852.51	3.25
188	002373	千方科技	8,748,670.00	3.23
189	300002	神州泰岳	8,734,600.00	3.23
190	002127	南极电商	8,712,850.98	3.22
191	600820	隧道股份	8,712,761.90	3.22
192	603806	福斯特	8,680,281.89	3.21
193	603000	人民网	8,675,150.57	3.20
194	600755	厦门国贸	8,650,814.00	3.19
195	600166	福田汽车	8,622,671.00	3.18
196	600875	东方电气	8,617,119.82	3.18
197	002223	鱼跃医疗	8,586,678.37	3.17
198	600649	城投控股	8,521,726.00	3.15
199	002385	大北农	8,518,864.00	3.15
200	000596	古井贡酒	8,491,069.00	3.14
201	603816	顾家家居	8,485,719.51	3.13
202	002174	游族网络	8,477,814.25	3.13
203	000623	吉林敖东	8,452,042.80	3.12
204	600597	光明乳业	8,397,164.74	3.10
205	601718	际华集团	8,382,262.00	3.10

206	000066	中国长城	8,372,695.09	3.09
207	000656	金科股份	8,365,368.12	3.09
208	300360	炬华科技	8,350,338.42	3.08
209	300459	金科文化	8,346,131.20	3.08
210	600600	青岛啤酒	8,342,160.84	3.08
211	600060	海信视像	8,316,055.00	3.07
212	300287	飞利信	8,295,686.00	3.06
213	600258	首旅酒店	8,278,918.38	3.06
214	600804	鹏博士	8,214,914.00	3.03
215	002013	中航机电	8,071,272.50	2.98
216	000537	广宇发展	8,033,642.84	2.97
217	002157	正邦科技	8,003,815.00	2.96
218	600418	江淮汽车	7,928,626.41	2.93
219	600598	北大荒	7,898,040.00	2.92
220	002221	东华能源	7,897,305.79	2.92
221	600138	中青旅	7,875,243.00	2.91
222	600017	日照港	7,860,749.83	2.90
223	600664	哈药股份	7,844,960.00	2.90
224	600388	龙净环保	7,834,693.04	2.89
225	000813	德展健康	7,834,380.74	2.89
226	002242	九阳股份	7,808,226.48	2.88
227	002439	启明星辰	7,733,640.68	2.86
228	000600	建投能源	7,697,657.84	2.84
229	603025	大豪科技	7,668,639.72	2.83
230	600143	金发科技	7,641,888.00	2.82
231	000887	中鼎股份	7,609,736.00	2.81
232	002131	利欧股份	7,583,327.68	2.80
233	600039	四川路桥	7,566,324.84	2.79
234	002408	齐翔腾达	7,527,815.16	2.78
235	002128	露天煤业	7,520,194.12	2.78
236	000987	越秀金控	7,484,578.20	2.76

237	002051	中工国际	7,482,787.78	2.76
238	002701	奥瑞金	7,478,942.04	2.76
239	300367	东方网力	7,457,880.29	2.75
240	000400	许继电气	7,443,170.26	2.75
241	600519	贵州茅台	7,414,592.00	2.74
242	000829	天音控股	7,383,376.41	2.73
243	002491	通鼎互联	7,372,215.12	2.72
244	600338	西藏珠峰	7,357,681.68	2.72
245	600694	大商股份	7,354,980.27	2.72
246	002573	清新环境	7,343,811.02	2.71
247	002815	崇达技术	7,296,868.30	2.69
248	002507	涪陵榨菜	7,283,911.25	2.69
249	600094	大名城	7,281,071.58	2.69
250	601668	中国建筑	7,271,841.00	2.69
251	600729	重庆百货	7,257,202.95	2.68
252	603328	依顿电子	7,216,570.34	2.67
253	600098	广州发展	7,203,075.34	2.66
254	601607	上海医药	7,130,083.00	2.63
255	000061	农产品	7,125,837.00	2.63
256	000636	风华高科	7,078,324.00	2.61
257	603228	景旺电子	7,005,757.68	2.59
258	603869	新智认知	6,999,475.86	2.59
259	000988	华工科技	6,921,447.00	2.56
260	600195	中牧股份	6,882,852.55	2.54
261	000069	华侨城 A	6,868,028.00	2.54
262	300341	麦克奥迪	6,855,371.00	2.53
263	603688	石英股份	6,822,512.27	2.52
264	000975	银泰黄金	6,821,430.84	2.52
265	300115	长盈精密	6,814,308.76	2.52
266	002468	申通快递	6,770,759.84	2.50
267	600582	天地科技	6,764,539.00	2.50

268	601225	陕西煤业	6,763,482.00	2.50
269	300291	华录百纳	6,758,005.25	2.50
270	600895	张江高科	6,745,287.93	2.49
271	002217	合力泰	6,726,052.00	2.48
272	600823	世茂股份	6,682,472.60	2.47
273	600585	海螺水泥	6,639,066.19	2.45
274	000031	大悦城	6,618,891.90	2.44
275	601689	拓普集团	6,613,404.00	2.44
276	603877	太平鸟	6,610,002.27	2.44
277	002541	鸿路钢构	6,593,979.00	2.44
278	002028	思源电气	6,591,494.00	2.43
279	600886	国投电力	6,571,088.50	2.43
280	000541	佛山照明	6,556,637.50	2.42
281	002281	光迅科技	6,551,122.77	2.42
282	002340	格林美	6,526,343.60	2.41
283	002544	杰赛科技	6,448,156.00	2.38
284	000519	中兵红箭	6,436,548.00	2.38
285	601211	国泰君安	6,404,104.00	2.37
286	601958	金钼股份	6,399,901.73	2.36
287	600717	天津港	6,398,362.38	2.36
288	601019	山东出版	6,378,637.00	2.36
289	300168	万达信息	6,374,444.05	2.35
290	002589	瑞康医药	6,363,651.00	2.35
291	600971	恒源煤电	6,353,183.89	2.35
292	603444	吉比特	6,331,630.34	2.34
293	600307	酒钢宏兴	6,324,951.00	2.34
294	000750	国海证券	6,309,501.00	2.33
295	600525	长园集团	6,294,044.00	2.32
296	002831	裕同科技	6,280,192.72	2.32
297	600787	中储股份	6,263,511.50	2.31
298	300207	欣旺达	6,258,071.00	2.31

299	600594	益佰制药	6,246,134.00	2.31
300	601699	潞安环能	6,187,654.88	2.29
301	600267	海正药业	6,187,207.00	2.29
302	000990	诚志股份	6,163,532.00	2.28
303	002183	怡亚通	6,160,535.00	2.28
304	000651	格力电器	6,146,814.00	2.27
305	000158	常山北明	6,092,373.62	2.25
306	600291	西水股份	6,083,054.00	2.25
307	002007	华兰生物	6,068,238.00	2.24
308	600993	马应龙	6,067,481.02	2.24
309	002563	森马服饰	6,021,580.32	2.22
310	002368	太极股份	6,003,270.64	2.22
311	300223	北京君正	5,996,971.10	2.21
312	002212	南洋股份	5,980,694.00	2.21
313	300219	鸿利智汇	5,976,781.18	2.21
314	002064	华峰氨纶	5,956,445.03	2.20
315	000301	东方盛虹	5,937,644.13	2.19
316	601928	凤凰传媒	5,926,077.00	2.19
317	601001	大同煤业	5,893,610.52	2.18
318	002600	领益智造	5,889,944.00	2.18
319	300502	新易盛	5,883,913.00	2.17
320	002714	牧原股份	5,882,751.20	2.17
321	600298	安琪酵母	5,872,896.27	2.17
322	600757	长江传媒	5,872,052.00	2.17
323	002085	万丰奥威	5,863,952.00	2.17
324	002372	伟星新材	5,846,893.21	2.16
325	300418	昆仑万维	5,834,902.75	2.15
326	603899	晨光文具	5,828,178.70	2.15
327	600848	上海临港	5,822,994.10	2.15
328	600383	金地集团	5,822,735.00	2.15
329	000552	靖远煤电	5,801,068.00	2.14

330	600022	山东钢铁	5,787,834.00	2.14
331	601900	南方传媒	5,745,754.00	2.12
332	000970	中科三环	5,735,572.00	2.12
333	600486	扬农化工	5,735,539.00	2.12
334	300347	泰格医药	5,689,673.88	2.10
335	000877	天山股份	5,675,618.00	2.10
336	000006	深振业 A	5,652,582.00	2.09
337	002517	恺英网络	5,618,766.80	2.08
338	002506	协鑫集成	5,554,091.00	2.05
339	601020	华钰矿业	5,547,684.34	2.05
340	002470	金正大	5,532,805.31	2.04
341	300113	顺网科技	5,506,136.73	2.03
342	600497	驰宏锌锗	5,449,312.12	2.01
343	002277	友阿股份	5,440,077.00	2.01
344	300253	卫宁健康	5,438,417.00	2.01

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	5,585,452,716.25
卖出股票收入(成交)总额	5,416,330,077.57

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,508,700.00	2.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,067,500.00	1.58
	其中:政策性金融债	9,067,500.00	1.58
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	23,576,200.00	4.11

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19国债01	145,000	14,508,700.00	2.53
2	018007	国开1801	90,000	9,067,500.00	1.58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2001	IC2001	5	5,266,800.00	120,125.00	-
公允价值变动总额合计（元）					120,125.00

股指期货投资本期收益（元）	617,193.84
股指期货投资本期公允价值变动（元）	120,125.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2019年1月4日,紫光国芯微电子股份有限公司(下称“紫光国微”,股票代码:002049)董事会秘书杜林虎收到中国证券监督管理委员会河北监管局下发的《河北证监局关于对杜林虎采取监管谈话行政监管措施的决定》,认定紫光国微全资子公司紫光同芯微电子有限公司与公司关联方山东新恒汇电子科技有限公司日常关联交易累计金额超过三百万元且占2017年度经审计归属于上市公司股东净资产的0.5%以上,但公司未及时进行审议和披露。构成了违反《上市公司信息披露管理办法》(以下简称《管理办法》)第二条和第四十八条的行为。杜林虎作为紫光国微董事会秘书,对上述违规行为负主要责任。2019年1月9日,闻泰科技股份有限公司(下称“闻泰科技”,股票代码:600745)及高管吴年有、周斌、李时英、曾海成收到上海证券交易所的监管关注,闻泰科技2018年4月28日披露的2017年度内部控制审计报告,根据上述报告,中茵集团向徐州中茵提供的借款利率由银行同期贷款利率4.35%改为年利率11.15%,借款期限展期为2017年1月1日至2018年12月21日止,公司未就上述关联借款提交董事会审议,截至公司2017年年报出具日仍未履行审批程序。据此,公司2017年度内部控制审计报告被出具带强调事项段的审计意见。上海证券交易所认定上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》以及在《董事、高级管理人员声明及承诺书》中做出的承诺,并对闻泰科技股份有限公司及时任董事会秘书吴年有和周斌、财务总监李时英和曾海成予以监管关注。2019年8月16日,闻泰科技股份有限公司(下称“闻泰科技”,股票代码:600745)重大资产重组

财务顾问项目主办人王茜、刘光懿、张辉、樊灿宇、许曦 收到上海证券交易所的监管关注,认定闻泰科技重大资产重组财务顾问华英证券有限责任公司(以下简称华英证券)项目主办人王茜、刘光懿,华泰联合证券有限责任公司(以下简称华泰联合)项目主办人张辉、樊灿宇、许曦存在未能对公司重大资产重组停复牌事项审慎出具核查意见;未能督促公司及时披露重组预案、草案等相关信息披露文件,且未及时就上述信息披露文件出具核查意见 两项违规行为。并对王茜、刘光懿、张辉、樊灿宇、许曦予以监管关注 中证500指数增强是模型驱动的量化基金,基金持仓由量化选股模型,风险模型和优化器共同决定。选股模型会综合考虑基本面,技术面,分析师预期和新闻事件来做出股票评价。经过模型选股和风险优化之后我们认为紫光国微电子具有投资价值,投资组合决定持有紫光国微电子。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	990,135.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	462,040.45
5	应收申购款	4,585,589.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,037,766.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证500增强A	22,426	16,000.91	95,518,328.96	26.62%	263,318,004.05	73.38%
创金合信中证500增强C	29,648	7,102.34	70,116,361.34	33.30%	140,453,751.58	66.70%
合计	50,961	11,173.38	165,634,690.30	29.09%	403,771,755.63	70.91%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证500增强A	108,409.82	0.03%
	创金合信中证500增强C	117,738.98	0.06%
	合计	226,148.80	0.04%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证500增强A	0~10
	创金合信中证500增强C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.76%	10,000,000.00	1.76%	36月
基金管理人高级管理人员	17,106.55	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	35,513.16	0.01%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,052,619.71	1.77%	10,000,000.00	1.76%	36月

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证500增强A	创金合信中证500增强C
基金合同生效日(2015年12月31日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	213,799,076.87	139,381,177.58
本报告期基金总申购份额	658,542,572.70	515,060,160.96
减：本报告期基金总赎回份额	513,505,316.56	443,871,225.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	358,836,333.01	210,570,112.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

自2019年12月18日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用60,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为4年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	1,833,720,984.59	16.70%	589,160.13	16.09%	-
招商证券	2	1,355,738,452.47	12.35%	570,945.49	15.59%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,539,406,276.19	14.02%	494,202.94	13.49%	-
长江证券	2	4,443,388,615.28	40.46%	1,427,741.57	38.98%	-
安信证券	2	968,326,948.93	8.82%	311,253.16	8.50%	-
中信建投证券	2	841,180,698.59	7.66%	269,447.62	7.36%	-

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。

本基金本报告期内无交易单元变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	4,009,940.00	5.93%	27,900,000.00	45.07%	-	-	-	-
招商证券	1,101,555.50	1.63%	7,100,000.00	11.47%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	23,649,426.30	34.99%	6,600,000.00	10.66%	-	-	-	-
长江证券	19,716,406.81	29.17%	15,100,000.00	24.39%	-	-	-	-
安信证券	1,013,928.60	1.50%	5,200,000.00	8.40%	-	-	-	-
中信建投证券	18,100,473.00	26.78%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证500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暨参加华泰证券费率优惠活动	公司官网、中国证券报	2019-01-07

	的公告		
2	创金合信中证500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、中国证券报	2019-01-19
3	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中投证券为代销机构	公司官网、中国证券报	2019-01-30
4	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2018年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2019-02-13
5	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第2号）	公司官网、中国证券报	2019-02-13
6	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、中国证券报	2019-03-28
7	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告	公司官网、中国证券报	2019-03-29
8	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2019-03-29
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、中国证券报	2019-04-04
10	创金合信中证500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、中国证券报	2019-04-22
11	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报	2019-07-06

12	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年第2季度报告	公司官网、中国证券报	2019-07-18
13	创金合信中证500指数增强型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、中国证券报	2019-08-13
14	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	公司官网、中国证券报	2019-08-13
15	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告	公司官网、中国证券报	2019-08-27
16	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2019-08-27
17	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年第三季度报告	公司官网、中国证券报	2019-10-23
18	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金（2019年11月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2019-11-29
19	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2019年11月修订）	公司官网、中国证券报	2019-11-29
20	创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2019年11月修订）	公司官网、中国证券报	2019-11-29

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；2、《创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；3、创金合信中证500指数增强型发起式证券投资基金2019年年度报告。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

13.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇二〇年四月三十日