

创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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	78
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	78
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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	79
§9 基金份额持有人信息.....	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	81
§10 开放式基金份额变动.....	82
§11 重大事件揭示.....	82
11.1 基金份额持有人大会决议.....	82
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.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	82
11.4 基金投资策略的改变.....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
11.8 其他重大事件.....	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§13 备查文件目录.....	88
13.1 备查文件目录.....	88
13.2 存放地点.....	88
13.3 查阅方式.....	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数	
基金主代码	005567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	99,039,630.47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MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567	005568
报告期末下属分级基金的份额总额	83,112,702.25份	15,926,928.22份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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日起信息披露报纸由《中国证券报》、《上海证券报》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（特殊普通合伙）	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
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标、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02月07日（基金合同生效日）-2018年12月31日	
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
本期已实现收益	6,016,458.33	1,881,738.94	-2,398,782.09	-705,606.51
本期利润	21,743,141.49	7,142,384.29	-15,628,792.24	-3,873,808.29
加权平均基金份额本期利润	0.3382	0.3402	-0.2262	-0.2240
本期加权平均净值利润率	34.05%	34.16%	-24.96%	-24.95%
本期基金份额净值增长率	39.95%	39.63%	-21.10%	-21.27%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	4,067,019.03	708,401.05	-13,448,813.18	-3,950,770.04
期末可供分配基金份额利润	0.0489	0.0445	-0.2110	-0.2127
期末基金资产净值	91,772,275.20	17,508,531.87	50,286,784.20	14,620,624.84
期末基金份额净值	1.1042	1.0993	0.7890	0.7873

3.1.3 累计期末指标	2019年末		2018年末	
基金份额累计净值增长率	10.42%	9.93%	-21.10%	-21.27%

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。

4. 本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

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MSCI中国A股国际指数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	7.16%	0.72%	9.63%	0.79%	-2.47%	-0.07%
过去六个月	10.34%	0.81%	5.82%	0.93%	4.52%	-0.12%
过去一年	39.95%	1.16%	30.96%	1.27%	8.99%	-0.11%
自基金合同生效起至今	10.42%	1.21%	-12.62%	1.34%	23.04%	-0.13%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.10%	0.72%	9.63%	0.79%	-2.53%	-0.07%
过去六个月	10.23%	0.81%	5.82%	0.93%	4.41%	-0.12%

过去一年	39.63%	1.16%	30.96%	1.27%	8.67%	-0.11%
自基金合同生效起至今	9.93%	1.21%	-12.62%	1.34%	22.55%	-0.13%

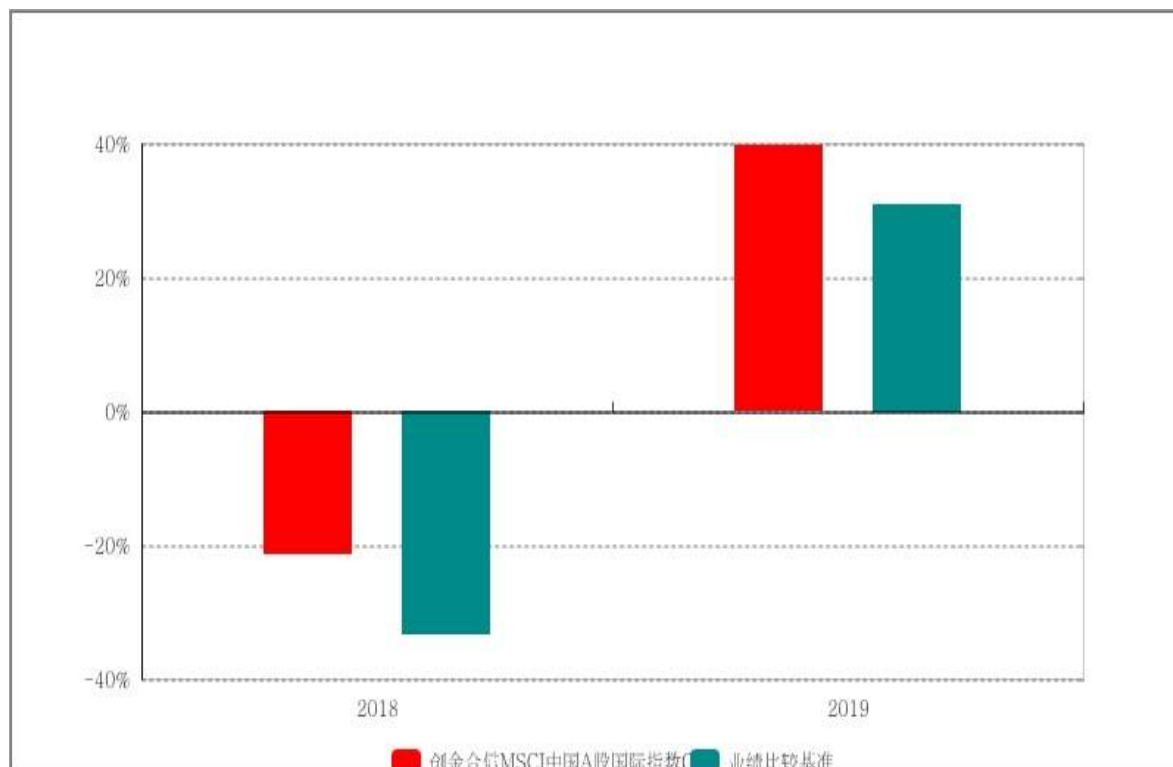
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日(2018年2月7日)至本报告期末未发生利润分配。

§ 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日正式注册成立，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		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	12年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部副总监、基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数，业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的，考虑了境外投资者投资A股的相关限制（外资投资比例）和流动性因素（换手率等指标），入选的样本股主要为大中盘股票，其总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为55%左右。本基金的投资策略，正常情况下主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为1.1042元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为39.95%，同期业绩比较基准收益率为30.96%；截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为1.0993元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为39.63%，同期业绩比较基准收益率为30.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

岁末年初，中美贸易谈判达成第一阶段协议，为来年中国经济设立了一个相对稳定的外部环境，宏观经济运行将企稳向好。同时有更多时间和空间继续推进经济结构改革和产业转型升级，未来高科技、新兴产业有望成为中国经济实现中高速增长的新动力。新型冠状病毒疫情或对经济造成短期的冲击，但不影响中长期经济发展的趋势。

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

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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24950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MSCI中国A股国际指数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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“创金合信MSCI中国A股国际指数基金”)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MSCI中国A股国际指数基金 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	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信MSCI中国A股国际指数基金,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	创金合信MSCI中国A股国际指数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

	<p>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MSCI中国A股国际指数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MSCI中国A股国际指数基金、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MSCI中国A股国际指数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:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</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</p>

	<p>理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对创金合信MSCI中国A股国际指数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MSCI中国A股国际指数基金不能持续经营。（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MSCI中国A股国际指数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	4,777,818.20	1,865,175.94

结算备付金		1,097,539.98	163,034.63
存出保证金		177,463.73	95,516.98
交易性金融资产	7.4.7.2	104,361,102.37	63,147,040.42
其中：股票投资		102,517,377.37	60,133,840.42
基金投资		-	-
债券投资		1,843,725.00	3,013,200.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	28,480.30	84,355.38
应收股利		-	-
应收申购款		62,677.13	34,470.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		110,505,081.71	65,389,593.60
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		-	-
应付赎回款		892,002.73	241,004.88
应付管理人报酬		64,765.59	28,456.64
应付托管费		12,953.15	5,691.31
应付销售服务费		8,435.68	2,565.16
应付交易费用	7.4.7.7	128,370.08	2,515.35

应交税费		657.64	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	117,089.77	201,951.22
负债合计		1,224,274.64	482,184.56
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	99,039,630.47	82,306,992.26
未分配利润	7.4.7.10	10,241,176.60	-17,399,583.22
所有者权益合计		109,280,807.07	64,907,409.04
负债和所有者权益总计		110,505,081.71	65,389,593.60

注：1. 报告截止日2019年12月31日，基金份额总额99,039,630.47份，其中下属A类基金份额83,112,702.25份，C类基金份额15,926,928.22份。下属A类基金份额净值1.1042元，C类基金份额净值1.0993元。

2. 本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数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02月07日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入		30,000,429.64	-18,722,306.84
1. 利息收入		119,478.24	121,395.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,342.45	35,646.39
债券利息收入		91,135.79	85,749.04
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）		8,774,317.44	-2,509,964.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,161,353.83	-4,043,221.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-19,639.04	2,001.40
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	253,223.31	-150,540.00
股利收益	7.4.7.15	1,379,379.34	1,681,796.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	20,987,328.51	-16,398,211.93
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	119,305.45	64,473.70
减：二、费用		1,114,903.86	780,293.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	418,757.45	349,445.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	83,751.56	69,889.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	41,309.91	27,758.96
4. 交易费用	7.4.7.18	421,933.97	110,441.89
5. 利息支出		5,714.50	-
其中：卖出回购金融资产支出		5,714.50	-
6. 税金及附加		911.60	-
7. 其他费用	7.4.7.19	142,524.87	222,757.90

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,885,525.78	-19,502,600.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,885,525.78	-19,502,600.53

注：本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数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)	82,306,992.26	-17,399,583.22	64,907,409.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,885,525.78	28,885,525.78
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)	16,732,638.21	-1,244,765.96	15,487,872.25
其中：1. 基金申购款	138,542,867.69	4,578,554.88	143,121,422.57
2. 基金赎回款	-121,810,229.48	-5,823,320.84	-127,633,550.32
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）	99,039,630.47	10,241,176.60	109,280,807.07
项 目	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年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）	68,378,462.98	-	68,378,462.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,502,600.53	-19,502,600.53
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）	13,928,529.28	2,103,017.31	16,031,546.59
其中：1. 基金申购款	42,899,302.94	-882,974.60	42,016,328.34
2. 基金赎回款	-28,970,773.66	2,985,991.91	-25,984,781.75
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）	82,306,992.26	-17,399,583.22	64,907,409.04

注：本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年12月31日。

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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2442号《关于准予创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币68,365,796.39元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为68,378,462.98份基金份额,其中认购资金利息折合12,666.59份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,900.09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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成分股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:MSCI中国A股国际指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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MSCI中国A股国际指数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。比较财务报表的实际编制期间为2018年2月7日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

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其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；(6) 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。

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	4,777,818.20	1,865,175.94
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	4,777,818.20	1,865,175.94

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		97,949,027.76	102,517,377.37	4,568,349.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,842,818.03	1,843,725.00	906.97
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,842,818.03	1,843,725.00	906.97
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		99,791,845.79	104,361,102.37	4,569,256.58
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		76,490,056.55	60,133,840.42	-16,356,216.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,008,395.80	3,013,200.00	4,804.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,008,395.80	3,013,200.00	4,804.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		79,498,452.35	63,147,040.42	-16,351,411.93

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	1,215,060.00	-	-	-
股指期货	1,215,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,215,060.00	-	-	-
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	949,020.00	-	-	-
股指期货	949,020.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	949,020.00	-	-	-

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

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	1,166.73	398.17
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	515.19	69.64
应收债券利息	26,771.65	83,884.93
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	26.73	2.64
合计	28,480.30	84,355.38

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	128,370.08	2,515.35
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	128,370.08	2,515.35

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	77.12	8.38
预提费用	117,012.65	201,942.84
合计	117,089.77	201,951.22

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数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	63,735,597.38	63,735,597.38
本期申购	81,545,367.59	81,545,367.59
本期赎回(以“-”号填列)	-62,168,262.72	-62,168,262.72
本期末	83,112,702.25	83,112,702.25

7.4.7.9.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数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	18,571,394.88	18,571,394.88
本期申购	56,997,500.10	56,997,500.10
本期赎回(以“-”号填列)	-59,641,966.76	-59,641,966.76
本期末	15,926,928.22	15,926,928.22

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MSCI中国A股国际指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,338,180.03	-11,110,633.15	-13,448,813.18
本期利润	6,016,458.33	15,726,683.16	21,743,141.49
本期基金份额交易产生的变动数	388,740.73	-23,496.09	365,244.64
其中：基金申购款	643,935.88	2,163,966.91	2,807,902.79
基金赎回款	-255,195.15	-2,187,463.00	-2,442,658.15

本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,067,019.03	4,592,553.92	8,659,572.95

7.4.7.10.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-716,799.44	-3,233,970.60	-3,950,770.04
本期利润	1,881,738.94	5,260,645.35	7,142,384.29
本期基金份额交易产生的变动数	-456,538.45	-1,153,472.15	-1,610,010.60
其中：基金申购款	422,988.07	1,347,664.02	1,770,652.09
基金赎回款	-879,526.52	-2,501,136.17	-3,380,662.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	708,401.05	873,202.60	1,581,603.65

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02月07日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	20,313.55	32,420.36
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	7,812.29	3,002.29
其他	216.61	223.74
合计	28,342.45	35,646.39

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年01月01日至 2019年12月31日	2018年02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	190,940,925.78	22,275,453.26
减：卖出股票成本总额	183,779,571.95	26,318,674.97
买卖股票差价收入	7,161,353.83	-4,043,221.71

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2 019年12月31日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效 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	-19,639.04	2,001.40
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	-19,639.04	2,001.40

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02月07日（基金合同生效日） 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	8,177,467.03	1,024,166.03
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	7,979,635.04	1,002,798.60
减：应收利息总额	217,471.03	19,366.03

买卖债券差价收入	-19,639.04	2,001.40
----------	------------	----------

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02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
期货投资	253,223.31	-150,540.00

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02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,379,379.34	1,681,796.27
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,379,379.34	1,681,796.27

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20 19年12月31日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	20,920,668.51	-16,351,411.93
——股票投资	20,924,565.74	-16,356,216.13
——债券投资	-3,897.23	4,804.20
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2. 衍生工具	66,660.00	-46,800.00
——权证投资	-	-
——期货投资	66,660.00	-46,800.00
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	20,987,328.51	-16,398,211.93

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02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	116,852.57	64,281.14
转换费收入	2,452.88	192.56
合计	119,305.45	64,473.70

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02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	421,756.04	110,365.93
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	177.93	75.96
合计	421,933.97	110,441.89

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年01月01日至 2019年12月31日	2018年02月07日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
审计费用	30,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	160,000.00
汇划手续费	4,835.99	3,044.71
指数使用费	27,688.88	24,313.19
账户维护费	-	400.00
合计	142,524.87	222,757.90

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02月07日（基金合同生效日） 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	119,514,467.80	30.69%	88,882,277.34	71.26%

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02月07日（基金合同生效日） 至2018年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额	成交金额	占当期 债券成 交总额

		的比例		的比例
第一创业 证券股份 有限公司	8,658,831.97	73.54%	3,010,194.40	60.01%

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02月07日（基金合同生效日） 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	6,300,000.00	15.79%	-	-

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	86,365.88	47.51%	48,952.50	38.13%
关联方名称	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	64,399.83	83.61%	-	-

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2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同 生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	418,757.45	349,445.80
其中：支付销售机构的客户维护费	166,063.26	169,930.37

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

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	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生 效日）至2018年12月31日
----	----------------------------------	---

	日	
当期发生的基金应支付的托管费	83,751.56	69,889.14

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

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MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	8,115.55	8,115.55
第一创业证券	0.00	175.50	175.50
创金合信直销	0.00	19,344.83	19,344.83
合计	0.00	27,635.88	27,635.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	6,574.51	6,574.51
创金合信直销	0.00	8,117.37	8,117.37

第一创业 证券	0.00	0.84	0.84
合计	0.00	14,692.72	14,692.72

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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MSCI中国A股国际指数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02月07日（基金合同 生效日）至2018年12月31日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	-	5,000,450.09
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09	-
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	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.02%	7.85%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

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02月07日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	-	5,000,450.00
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-
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	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.40%	26.93%

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 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日） 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	4,777,818.20	20,313.55	1,865,175.94	32,420.36

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

于2019年12月31日，本基金持有69,790.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币2,511,417.42元，估值总额为2,622,708.20元，占基金资产净值比例为2.40%；持有12,100.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币99,338.50元，估值总额为100,188.00元，占基金资产净值比例为0.09%（2018年12月31日：本基金持有66,600.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币1,907,705.23元，估值总额为1,678,320.00元，占基金资产净值比例为2.59%）。

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
003816	中国广核	2019-08-14	2020-02-27	新股锁定	2.49	3.53	562,958	1,401,765.42	1,987,241.74	-

688300	联瑞新材	2019-11-07	2020-05-15	新股锁定	27.28	39.84	3,164	86,313.92	126,053.76	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新发流通受限	28.21	28.21	3,101	87,479.21	87,479.21	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	配股流通受限	8.75	30.18	2,490	21,787.50	75,148.20	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新发流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	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
603799	华友钴业	2019-12-31	重大事项停牌	39.39	2020-01-02	40.43	3,756	117,724.25	147,948.84	-

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	-	-
未评级	1,843,725.00	3,013,200.00
合计	1,843,725.00	3,013,200.00

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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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时间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2.16%。

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106,873,067.76元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查

与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	4,777,818.20	-	-	-	4,777,818.20
结算备付金	1,097,539.98	-	-	-	1,097,539.98
存出保证金	177,463.73	-	-	-	177,463.73

交易性金融资产	1,843,725.00	-	-	102,517,377.37	104,361,102.37
应收利息	-	-	-	28,480.30	28,480.30
应收申购款	-	-	-	62,677.13	62,677.13
资产总计	7,896,546.91	-	-	102,608,534.80	110,505,081.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	892,002.73	892,002.73
应付管理人报酬	-	-	-	64,765.59	64,765.59
应付托管费	-	-	-	12,953.15	12,953.15
应付销售服务费	-	-	-	8,435.68	8,435.68
应付交易费用	-	-	-	128,370.08	128,370.08
应交税费	-	-	-	657.64	657.64
其他负债	-	-	-	117,089.77	117,089.77
负债总计	-	-	-	1,224,274.64	1,224,274.64
利率敏感度缺口	7,896,546.91	-	-	101,384,260.16	109,280,807.07
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	1,865,175.94	-	-	-	1,865,175.94
结算备付金	163,034.63	-	-	-	163,034.63
存出保证金	95,516.98	-	-	-	95,516.98
交易性金融资产	3,013,200.00	-	-	60,133,840.42	63,147,040.42
应收利息	-	-	-	84,355.38	84,355.38
应收申购款	-	-	-	34,470.25	34,470.25
资产总计	5,136,927.55	-	-	60,252,666.05	65,389,593.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	241,004.88	241,004.88
应付管理人报酬	-	-	-	28,456.64	28,456.64
应付托管费	-	-	-	5,691.31	5,691.31
应付销售服务费	-	-	-	2,565.16	2,565.16
应付交易费用	-	-	-	2,515.35	2,515.35
其他负债	-	-	-	201,951.22	201,951.22
负债总计	-	-	-	482,184.56	482,184.56
利率敏感度缺口	5,136,927.55	-	-	59,770,481.49	64,907,409.04

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1.69%(2018年12月31日：4.64%)，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	102,517,377.37	93.81	60,133,840.42	92.65
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	102,517,377.37	93.81	60,133,840.42	92.65

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%	5,161,608.04	3,063,897.21
	比较基准下降5%	-5,161,608.04	-3,063,897.21

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100,086,927.58元，属于第二层次的余额为4,274,174.79元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次59,592,255.42元，第二层次3,554,785.00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	102,517,377.37	92.77
	其中：股票	102,517,377.37	92.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,843,725.00	1.67
	其中：债券	1,843,725.00	1.67
	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	5,875,358.18	5.32
8	其他各项资产	268,621.16	0.24
9	合计	110,505,081.71	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	1,349,453.80	1.23
B	采矿业	3,121,905.40	2.86
C	制造业	46,912,425.93	42.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,892,054.40	2.65
E	建筑业	2,511,614.00	2.30
F	批发和零售业	1,804,429.55	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,947,964.00	2.70
H	住宿和餐饮业	136,107.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,325,911.14	3.96
J	金融业	25,920,655.47	23.72
K	房地产业	4,471,836.60	4.09
L	租赁和商务服务业	1,228,433.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	545,587.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	127,822.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	972,715.60	0.89
R	文化、体育和娱乐业	845,626.00	0.77
S	综合	155,846.00	0.14
	合计	100,270,386.89	91.75

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	-	-
C	制造业	253,170.70	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	1.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,246,990.48	2.06

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
					产净

					值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,200	4,968,600.00	4.55
2	601318	中国平安	36,558	3,124,246.68	2.86
3	600036	招商银行	69,790	2,622,708.20	2.40
4	000858	五粮液	13,100	1,742,431.00	1.59
5	601166	兴业银行	70,500	1,395,900.00	1.28
6	600900	长江电力	74,712	1,373,206.56	1.26
7	600276	恒瑞医药	15,000	1,312,800.00	1.20
8	600000	浦发银行	99,788	1,234,377.56	1.13
9	601398	工商银行	183,500	1,078,980.00	0.99
10	000002	万科A	33,100	1,065,158.00	0.97
11	002415	海康威视	31,800	1,041,132.00	0.95
12	000001	平安银行	58,497	962,275.65	0.88
13	601288	农业银行	254,000	937,260.00	0.86
14	600030	中信证券	33,553	848,890.90	0.78
15	603288	海天味业	7,600	817,076.00	0.75
16	601601	中国太保	21,400	809,776.00	0.74
17	601668	中国建筑	143,400	805,908.00	0.74
18	300750	宁德时代	7,400	787,360.00	0.72
19	600016	民生银行	121,180	764,645.80	0.70
20	601328	交通银行	134,100	754,983.00	0.69
21	600585	海螺水泥	13,600	745,280.00	0.68
22	000333	美的集团	11,800	687,350.00	0.63
23	000651	格力电器	10,300	675,474.00	0.62
24	002475	立讯精密	18,300	667,950.00	0.61
25	600048	保利地产	40,700	658,526.00	0.60
26	600887	伊利股份	20,800	643,552.00	0.59
27	600104	上汽集团	26,600	634,410.00	0.58
28	600050	中国联通	106,300	626,107.00	0.57
29	300498	温氏股份	18,200	611,520.00	0.56

30	601818	光大银行	136,400	601,524.00	0.55
31	600309	万华化学	10,700	601,019.00	0.55
32	601766	中国中车	83,400	595,476.00	0.54
33	601888	中国国旅	6,600	587,070.00	0.54
34	002304	洋河股份	5,100	563,550.00	0.52
35	002142	宁波银行	19,246	541,774.90	0.50
36	001979	招商蛇口	27,100	538,477.00	0.49
37	000725	京东方 A	116,200	527,548.00	0.48
38	002714	牧原股份	5,920	525,636.80	0.48
39	601688	华泰证券	25,300	513,843.00	0.47
40	600031	三一重工	28,800	491,040.00	0.45
41	601211	国泰君安	25,900	478,891.00	0.44
42	601229	上海银行	48,942	464,459.58	0.43
43	603259	药明康德	5,000	460,600.00	0.42
44	600028	中国石化	87,900	449,169.00	0.41
45	601988	中国银行	121,100	446,859.00	0.41
46	000568	泸州老窖	5,000	433,400.00	0.40
47	600837	海通证券	27,900	431,334.00	0.39
48	300015	爱尔眼科	10,660	421,709.60	0.39
49	601006	大秦铁路	51,300	421,173.00	0.39
50	000063	中兴通讯	11,800	417,602.00	0.38
51	601169	北京银行	72,900	414,072.00	0.38
52	601989	中国重工	78,900	413,436.00	0.38
53	600690	海尔智家	21,005	409,597.50	0.37
54	601186	中国铁建	39,700	402,558.00	0.37
55	000166	申万宏源	77,700	397,824.00	0.36
56	000538	云南白药	4,400	393,492.00	0.36
57	601390	中国中铁	64,300	381,942.00	0.35
58	600019	宝钢股份	64,000	367,360.00	0.34
59	300059	东方财富	23,200	365,864.00	0.33
60	600999	招商证券	19,700	360,313.00	0.33

61	601336	新华保险	7,200	353,880.00	0.32
62	600745	闻泰科技	3,800	351,500.00	0.32
63	600015	华夏银行	44,200	339,014.00	0.31
64	600406	国电南瑞	15,900	336,762.00	0.31
65	601628	中国人寿	9,600	334,752.00	0.31
66	000338	潍柴动力	20,700	328,716.00	0.30
67	601857	中国石油	55,900	325,897.00	0.30
68	600346	恒力石化	20,220	325,137.60	0.30
69	002024	苏宁易购	32,100	324,531.00	0.30
70	002027	分众传媒	50,600	316,756.00	0.29
71	601012	隆基股份	12,548	311,566.84	0.29
72	601899	紫金矿业	67,700	310,743.00	0.28
73	000776	广发证券	20,400	309,468.00	0.28
74	002594	比亚迪	6,300	300,321.00	0.27
75	600340	华夏幸福	10,400	298,480.00	0.27
76	600547	山东黄金	8,920	290,970.40	0.27
77	000876	新希望	14,500	289,275.00	0.26
78	601066	中信建投	9,500	288,800.00	0.26
79	600919	江苏银行	39,800	288,152.00	0.26
80	603501	韦尔股份	2,000	286,800.00	0.26
81	600741	华域汽车	10,900	283,291.00	0.26
82	601088	中国神华	15,200	277,400.00	0.25
83	000895	双汇发展	9,500	275,785.00	0.25
84	600809	山西汾酒	3,000	269,100.00	0.25
85	603160	汇顶科技	1,300	268,190.00	0.25
86	603993	洛阳钼业	60,900	265,524.00	0.24
87	002230	科大讯飞	7,600	262,048.00	0.24
88	600009	上海机场	3,300	259,875.00	0.24
89	600703	三安光电	14,100	258,876.00	0.24
90	601225	陕西煤业	28,700	258,013.00	0.24
91	601009	南京银行	29,300	256,961.00	0.24

92	300760	迈瑞医疗	1,400	254,660.00	0.23
93	601138	工业富联	13,705	250,390.35	0.23
94	601933	永辉超市	33,000	248,820.00	0.23
95	601901	方正证券	28,400	246,228.00	0.23
96	600588	用友网络	8,625	244,950.00	0.22
97	601939	建设银行	33,100	239,313.00	0.22
98	600436	片仔癀	2,100	230,727.00	0.21
99	300122	智飞生物	4,600	228,436.00	0.21
100	600383	金地集团	15,600	226,200.00	0.21
101	601985	中国核电	44,800	224,000.00	0.20
102	000661	长春高新	500	223,500.00	0.20
103	002241	歌尔股份	11,200	223,104.00	0.20
104	603986	兆易创新	1,088	222,920.32	0.20
105	600958	东方证券	20,600	221,656.00	0.20
106	000069	华侨城 A	28,300	220,457.00	0.20
107	600886	国投电力	23,400	214,812.00	0.20
108	002600	领益智造	19,700	213,745.00	0.20
109	600029	南方航空	29,700	213,246.00	0.20
110	000100	TCL 集团	46,700	208,749.00	0.19
111	002352	顺丰控股	5,600	208,264.00	0.19
112	300033	同花顺	1,900	207,309.00	0.19
113	002236	大华股份	10,300	204,764.00	0.19
114	300003	乐普医疗	6,100	201,788.00	0.18
115	002624	完美世界	4,500	198,630.00	0.18
116	601877	正泰电器	7,400	198,320.00	0.18
117	002311	海大集团	5,500	198,000.00	0.18
118	002555	三七互娱	7,300	196,589.00	0.18
119	600606	绿地控股	28,000	194,600.00	0.18
120	300601	康泰生物	2,200	193,138.00	0.18
121	002044	美年健康	12,900	192,081.00	0.18
122	601669	中国电建	44,000	190,960.00	0.17

123	600115	东方航空	32,200	187,082.00	0.17
124	000938	紫光股份	5,900	186,440.00	0.17
125	600061	国投资本	12,200	184,708.00	0.17
126	600196	复星医药	6,900	183,540.00	0.17
127	002493	荣盛石化	14,500	179,655.00	0.16
128	300413	芒果超媒	5,100	178,296.00	0.16
129	002736	国信证券	14,100	176,955.00	0.16
130	601788	光大证券	13,500	176,850.00	0.16
131	000596	古井贡酒	1,300	176,696.00	0.16
132	600438	通威股份	13,400	175,942.00	0.16
133	300124	汇川技术	5,700	174,648.00	0.16
134	600332	白云山	4,900	174,489.00	0.16
135	601872	招商轮船	20,900	172,634.00	0.16
136	601618	中国中冶	61,600	172,480.00	0.16
137	002001	新和成	7,400	172,124.00	0.16
138	300142	沃森生物	5,300	171,932.00	0.16
139	002916	深南电路	1,200	170,520.00	0.16
140	002120	韵达股份	5,100	169,830.00	0.16
141	600893	航发动力	7,800	169,104.00	0.15
142	600018	上港集团	29,300	169,061.00	0.15
143	002007	华兰生物	4,800	168,720.00	0.15
144	600660	福耀玻璃	6,900	165,531.00	0.15
145	300014	亿纬锂能	3,300	165,528.00	0.15
146	600183	生益科技	7,900	165,268.00	0.15
147	002050	三花智控	9,500	164,635.00	0.15
148	300347	泰格医药	2,600	164,190.00	0.15
149	601377	兴业证券	23,100	163,548.00	0.15
150	600926	杭州银行	17,740	162,498.40	0.15
151	600352	浙江龙盛	11,200	162,064.00	0.15
152	601600	中国铝业	45,100	159,654.00	0.15
153	002466	天齐锂业	5,290	159,652.20	0.15

154	600795	国电电力	67,700	158,418.00	0.14
155	000066	中国长城	10,100	157,156.00	0.14
156	300433	蓝思科技	11,300	156,166.00	0.14
157	000768	中航飞机	9,532	156,134.16	0.14
158	603899	晨光文具	3,200	155,968.00	0.14
159	300144	宋城演艺	5,000	154,550.00	0.14
160	600705	中航资本	31,000	150,350.00	0.14
161	300136	信维通信	3,300	149,754.00	0.14
162	600674	川投能源	15,200	149,720.00	0.14
163	002371	北方华创	1,700	149,600.00	0.14
164	601100	恒立液压	3,000	149,250.00	0.14
165	600271	航天信息	6,400	148,288.00	0.14
166	603799	华友钴业	3,756	147,948.84	0.14
167	000963	华东医药	6,060	147,742.80	0.14
168	000425	徐工机械	27,000	147,690.00	0.14
169	000157	中联重科	22,100	147,628.00	0.14
170	000786	北新建材	5,800	147,610.00	0.14
171	002146	荣盛发展	15,000	147,450.00	0.13
172	601990	南京证券	11,400	147,174.00	0.13
173	002032	苏泊尔	1,898	145,728.44	0.13
174	002202	金风科技	11,900	142,205.00	0.13
175	000656	金科股份	18,400	141,312.00	0.13
176	603369	今世缘	4,300	140,696.00	0.13
177	002179	中航光电	3,600	140,616.00	0.13
178	601108	财通证券	12,400	140,616.00	0.13
179	601021	春秋航空	3,200	140,448.00	0.13
180	601727	上海电气	28,000	139,440.00	0.13
181	300454	深信服	1,200	137,268.00	0.13
182	000860	顺鑫农业	2,600	136,968.00	0.13
183	000703	恒逸石化	9,800	136,416.00	0.12
184	000783	长江证券	19,100	136,374.00	0.12

185	002157	正邦科技	8,400	136,080.00	0.12
186	600111	北方稀土	12,500	135,500.00	0.12
187	000625	长安汽车	13,500	135,405.00	0.12
188	000961	中南建设	12,800	135,040.00	0.12
189	300450	先导智能	3,000	134,820.00	0.12
190	002271	东方雨虹	5,100	134,181.00	0.12
191	300408	三环集团	6,000	133,680.00	0.12
192	000723	美锦能源	14,100	132,963.00	0.12
193	601111	中国国航	13,700	132,753.00	0.12
194	002410	广联达	3,900	132,522.00	0.12
195	600085	同仁堂	4,700	132,446.00	0.12
196	000977	浪潮信息	4,400	132,440.00	0.12
197	002460	赣锋锂业	3,800	132,354.00	0.12
198	600176	中国巨石	12,120	132,108.00	0.12
199	002463	沪电股份	5,900	131,039.00	0.12
200	002739	万达电影	7,200	130,680.00	0.12
201	002384	东山精密	5,500	127,325.00	0.12
202	601198	东兴证券	9,500	124,830.00	0.11
203	600801	华新水泥	4,700	124,221.00	0.11
204	600023	浙能电力	31,300	123,948.00	0.11
205	600004	白云机场	7,100	123,895.00	0.11
206	300782	卓胜微	300	123,111.00	0.11
207	300628	亿联网络	1,700	123,097.00	0.11
208	600600	青岛啤酒	2,400	122,400.00	0.11
209	002353	杰瑞股份	3,300	121,968.00	0.11
210	600362	江西铜业	7,200	121,896.00	0.11
211	600536	中国软件	1,700	121,873.00	0.11
212	002180	纳思达	3,700	121,804.00	0.11
213	601607	上海医药	6,600	121,242.00	0.11
214	601998	中信银行	19,600	120,932.00	0.11
215	002153	石基信息	3,100	120,900.00	0.11

216	600584	长电科技	5,500	120,890.00	0.11
217	600177	雅戈尔	17,320	120,720.40	0.11
218	000627	天茂集团	17,000	119,680.00	0.11
219	300251	光线传媒	10,100	119,180.00	0.11
220	000671	阳光城	14,000	119,000.00	0.11
221	002673	西部证券	12,100	118,580.00	0.11
222	601919	中远海控	22,300	117,521.00	0.11
223	002422	科伦药业	5,000	117,450.00	0.11
224	603833	欧派家居	1,000	117,000.00	0.11
225	002812	恩捷股份	2,300	116,150.00	0.11
226	600482	中国动力	5,800	116,000.00	0.11
227	000050	深天马 A	7,100	115,659.00	0.11
228	603589	口子窖	2,100	115,311.00	0.11
229	601018	宁波港	30,300	115,140.00	0.11
230	002129	中环股份	9,600	113,376.00	0.10
231	601838	成都银行	12,500	113,375.00	0.10
232	600583	海油工程	15,300	112,914.00	0.10
233	600763	通策医疗	1,100	112,783.00	0.10
234	600208	新湖中宝	29,700	112,266.00	0.10
235	002508	老板电器	3,300	111,573.00	0.10
236	600637	东方明珠	11,899	111,374.64	0.10
237	600426	华鲁恒升	5,600	111,272.00	0.10
238	601360	三六零	4,700	110,497.00	0.10
239	002065	东华软件	10,700	110,424.00	0.10
240	600498	烽火通信	4,000	109,800.00	0.10
241	300308	中际旭创	2,100	109,515.00	0.10
242	601117	中国化学	17,000	109,480.00	0.10
243	002405	四维图新	6,777	109,109.70	0.10
244	600170	上海建工	30,700	108,678.00	0.10
245	600066	宇通客车	7,600	108,300.00	0.10
246	002601	龙蟒佰利	7,000	107,730.00	0.10

247	000999	华润三九	3,400	107,712.00	0.10
248	000728	国元证券	11,600	107,532.00	0.10
249	601992	金隅集团	28,777	107,338.21	0.10
250	603019	中科曙光	3,100	107,198.00	0.10
251	601878	浙商证券	9,600	106,848.00	0.10
252	002049	紫光国微	2,100	106,764.00	0.10
253	600673	东阳光	10,400	106,496.00	0.10
254	300383	光环新网	5,300	106,371.00	0.10
255	600872	中炬高新	2,700	106,245.00	0.10
256	600068	葛洲坝	15,900	106,212.00	0.10
257	600487	亨通光电	6,520	106,015.20	0.10
258	601997	贵阳银行	11,080	105,924.80	0.10
259	002439	启明星辰	3,100	104,780.00	0.10
260	603156	养元饮品	3,600	104,508.00	0.10
261	600150	中国船舶	4,800	104,448.00	0.10
262	002821	凯莱英	800	103,600.00	0.09
263	300207	欣旺达	5,300	103,456.00	0.09
264	002506	协鑫集成	17,500	103,425.00	0.09
265	601555	东吴证券	10,300	102,897.00	0.09
266	600369	西南证券	19,500	101,205.00	0.09
267	600760	中航沈飞	3,200	101,120.00	0.09
268	600489	中金黄金	11,900	100,912.00	0.09
269	600161	天坛生物	3,600	100,584.00	0.09
270	300529	健帆生物	1,400	100,576.00	0.09
271	002926	华西证券	9,100	100,191.00	0.09
272	002797	第一创业	12,100	100,188.00	0.09
273	600642	申能股份	16,900	98,189.00	0.09
274	600109	国金证券	10,400	96,720.00	0.09
275	603658	安图生物	1,000	96,380.00	0.09
276	601231	环旭电子	5,000	96,150.00	0.09
277	601238	广汽集团	8,200	95,858.00	0.09

278	600845	宝信软件	2,910	95,739.00	0.09
279	600038	中直股份	2,000	95,420.00	0.09
280	603939	益丰药房	1,300	95,186.00	0.09
281	601799	星宇股份	1,000	94,980.00	0.09
282	601233	桐昆股份	6,328	94,856.72	0.09
283	000709	河钢股份	36,600	94,428.00	0.09
284	601966	玲珑轮胎	4,100	94,013.00	0.09
285	603517	绝味食品	2,000	92,900.00	0.09
286	002127	南极电商	8,500	92,735.00	0.08
287	000975	银泰黄金	6,800	92,548.00	0.08
288	002773	康弘药业	2,500	92,425.00	0.08
289	600219	南山铝业	41,200	92,288.00	0.08
290	002373	千方科技	5,100	92,004.00	0.08
291	300558	贝达药业	1,400	91,980.00	0.08
292	600998	九州通	6,500	91,975.00	0.08
293	600297	广汇汽车	28,200	91,932.00	0.08
294	600704	物产中大	17,495	91,848.75	0.08
295	600011	华能国际	16,400	91,512.00	0.08
296	600909	华安证券	12,500	91,250.00	0.08
297	601216	君正集团	29,100	91,083.00	0.08
298	002690	美亚光电	2,300	89,930.00	0.08
299	600188	兖州煤业	8,500	89,760.00	0.08
300	300146	汤臣倍健	5,500	89,595.00	0.08
301	600867	通化东宝	7,040	89,056.00	0.08
302	600528	中铁工业	7,700	88,550.00	0.08
303	600132	重庆啤酒	1,700	88,332.00	0.08
304	600153	建发股份	9,800	88,102.00	0.08
305	600885	宏发股份	2,557	88,088.65	0.08
306	600522	中天科技	10,600	87,980.00	0.08
307	600779	水井坊	1,700	87,975.00	0.08
308	600655	豫园股份	11,200	87,808.00	0.08

309	600118	中国卫星	4,100	87,617.00	0.08
310	002078	太阳纸业	8,900	87,576.00	0.08
311	600875	东方电气	9,500	87,305.00	0.08
312	603707	健友股份	2,100	87,108.00	0.08
313	601800	中国交建	9,500	87,020.00	0.08
314	002299	圣农发展	3,600	86,688.00	0.08
315	002465	海格通信	8,000	86,640.00	0.08
316	601128	常熟银行	9,500	86,545.00	0.08
317	000629	攀钢钒钛	29,600	86,432.00	0.08
318	002013	中航机电	12,400	86,056.00	0.08
319	600027	华电国际	23,400	85,878.00	0.08
320	600298	安琪酵母	2,800	85,876.00	0.08
321	603338	浙江鼎力	1,200	85,800.00	0.08
322	603885	吉祥航空	5,700	85,500.00	0.08
323	600089	特变电工	12,800	85,120.00	0.08
324	300012	华测检测	5,700	84,987.00	0.08
325	002558	巨人网络	4,700	84,882.00	0.08
326	000630	铜陵有色	36,300	84,579.00	0.08
327	600155	华创阳安	6,000	84,180.00	0.08
328	600816	安信信托	18,900	83,916.00	0.08
329	300253	卫宁健康	5,600	83,888.00	0.08
330	000402	金融街	10,300	83,636.00	0.08
331	300070	碧水源	10,900	82,840.00	0.08
332	002411	延安必康	5,300	82,839.00	0.08
333	600977	中国电影	5,400	82,188.00	0.08
334	603882	金域医学	1,600	81,952.00	0.07
335	300699	光威复材	1,800	81,900.00	0.07
336	600688	上海石化	21,100	81,657.00	0.07
337	603858	步长制药	3,955	81,552.10	0.07
338	000423	东阿阿胶	2,300	81,351.00	0.07
339	002500	山西证券	9,800	81,242.00	0.07

340	002081	金螳螂	9,200	81,144.00	0.07
341	600895	张江高科	5,300	81,143.00	0.07
342	000031	大悦城	11,300	81,134.00	0.07
343	000415	渤海租赁	21,300	80,940.00	0.07
344	600739	辽宁成大	5,300	80,719.00	0.07
345	603866	桃李面包	1,900	80,636.00	0.07
346	600699	均胜电子	4,500	80,550.00	0.07
347	000825	太钢不锈	19,600	80,164.00	0.07
348	300017	网宿科技	8,400	80,052.00	0.07
349	600989	宝丰能源	8,400	79,884.00	0.07
350	600535	天士力	5,180	79,875.60	0.07
351	002152	广电运通	8,300	79,763.00	0.07
352	002110	三钢闽光	8,500	79,560.00	0.07
353	300357	我武生物	1,800	79,470.00	0.07
354	600398	海澜之家	10,200	78,336.00	0.07
355	000401	冀东水泥	4,600	78,246.00	0.07
356	002010	传化智联	11,200	78,176.00	0.07
357	600521	华海药业	4,520	78,015.20	0.07
358	600256	广汇能源	23,400	77,454.00	0.07
359	000750	国海证券	14,500	77,430.00	0.07
360	600497	驰宏锌锗	17,600	77,088.00	0.07
361	600466	蓝光发展	10,280	75,763.60	0.07
362	300024	机器人	5,400	75,600.00	0.07
363	600486	扬农化工	1,100	75,493.00	0.07
364	300285	国瓷材料	3,300	75,405.00	0.07
365	000686	东北证券	8,100	75,330.00	0.07
366	603000	人民网	3,800	75,202.00	0.07
367	601699	潞安环能	10,300	74,778.00	0.07
368	002387	维信诺	4,700	74,730.00	0.07
369	601958	金钼股份	9,300	74,493.00	0.07
370	601098	中南传媒	6,200	74,028.00	0.07

371	600201	生物股份	3,900	73,008.00	0.07
372	600415	小商品城	18,800	72,756.00	0.07
373	002385	大北农	14,600	72,708.00	0.07
374	600372	中航电子	5,100	72,624.00	0.07
375	600021	上海电力	9,000	72,450.00	0.07
376	002507	涪陵榨菜	2,700	72,171.00	0.07
377	002174	游族网络	3,100	72,137.00	0.07
378	600315	上海家化	2,300	71,162.00	0.07
379	002223	鱼跃医疗	3,500	71,120.00	0.07
380	002372	伟星新材	5,400	71,118.00	0.07
381	601866	中远海发	27,400	70,966.00	0.06
382	600511	国药股份	2,600	70,954.00	0.06
383	600376	首开股份	8,900	70,933.00	0.06
384	000513	丽珠集团	2,100	70,770.00	0.06
385	600733	北汽蓝谷	12,100	70,664.00	0.06
386	002399	海普瑞	3,600	70,236.00	0.06
387	000027	深圳能源	11,304	70,197.84	0.06
388	600258	首旅酒店	3,400	70,074.00	0.06
389	000932	华菱钢铁	14,600	69,788.00	0.06
390	002340	格林美	14,300	69,641.00	0.06
391	600460	士兰微	4,500	69,615.00	0.06
392	000089	深圳机场	7,100	69,367.00	0.06
393	600380	健康元	6,696	69,303.60	0.06
394	600160	巨化股份	9,500	69,160.00	0.06
395	601106	中国一重	23,700	68,967.00	0.06
396	600776	东方通信	3,300	68,739.00	0.06
397	600959	江苏有线	17,260	68,694.80	0.06
398	600968	海油发展	23,400	68,562.00	0.06
399	002281	光迅科技	2,300	68,494.00	0.06
400	600143	金发科技	9,400	68,432.00	0.06
401	002019	亿帆医药	4,200	68,250.00	0.06

402	600566	济川药业	2,800	67,704.00	0.06
403	300296	利亚德	8,800	67,496.00	0.06
404	002414	高德红外	3,200	67,200.00	0.06
405	000983	西山煤电	10,900	66,817.00	0.06
406	300595	欧普康视	1,400	66,262.00	0.06
407	000998	隆平高科	4,500	66,195.00	0.06
408	000623	吉林敖东	4,000	66,120.00	0.06
409	600754	锦江酒店	2,300	66,033.00	0.06
410	600373	中文传媒	4,800	65,328.00	0.06
411	600820	隧道股份	10,800	65,232.00	0.06
412	600675	中华企业	13,980	65,007.00	0.06
413	002572	索菲亚	3,100	64,945.00	0.06
414	600008	首创股份	19,600	64,484.00	0.06
415	601179	中国西电	17,700	64,428.00	0.06
416	601598	中国外运	15,100	64,326.00	0.06
417	002195	二三四五	19,900	64,277.00	0.06
418	603883	老百姓	1,000	64,080.00	0.06
419	600549	厦门钨业	4,900	63,896.00	0.06
420	600079	人福医药	4,700	63,497.00	0.06
421	000729	燕京啤酒	9,700	63,244.00	0.06
422	600808	马钢股份	20,600	63,242.00	0.06
423	600737	中粮糖业	7,400	62,604.00	0.06
424	000883	湖北能源	15,000	62,550.00	0.06
425	600446	金证股份	3,000	61,740.00	0.06
426	600967	内蒙一机	5,800	61,654.00	0.06
427	000898	鞍钢股份	18,400	61,640.00	0.06
428	002563	森马服饰	6,200	61,194.00	0.06
429	000960	锡业股份	5,800	60,552.00	0.06
430	600026	中远海能	9,400	59,972.00	0.05
431	002294	信立泰	3,000	59,820.00	0.05
432	603444	吉比特	200	59,698.00	0.05

433	601333	广深铁路	19,500	59,670.00	0.05
434	600567	山鹰纸业	15,800	59,566.00	0.05
435	600598	北大荒	6,100	59,414.00	0.05
436	002217	合力泰	10,700	59,385.00	0.05
437	000028	国药一致	1,300	58,968.00	0.05
438	000778	新兴铸管	13,800	57,546.00	0.05
439	000997	新大陆	3,600	57,168.00	0.05
440	002074	国轩高科	3,900	56,745.00	0.05
441	600572	康恩贝	9,200	56,580.00	0.05
442	600782	新钢股份	11,000	56,430.00	0.05
443	600879	航天电子	9,400	56,212.00	0.05
444	600392	盛和资源	6,100	55,327.00	0.05
445	000581	威孚高科	2,900	55,245.00	0.05
446	600273	嘉化能源	4,900	55,125.00	0.05
447	600863	内蒙华电	20,000	55,000.00	0.05
448	000046	泛海控股	12,000	54,600.00	0.05
449	600339	中油工程	16,100	54,579.00	0.05
450	601168	西部矿业	8,200	54,284.00	0.05
451	601880	大连港	26,700	54,201.00	0.05
452	600643	爱建集团	5,600	53,760.00	0.05
453	000830	鲁西化工	5,100	53,601.00	0.05
454	000503	国新健康	3,100	53,072.00	0.05
455	601000	唐山港	20,400	53,040.00	0.05
456	002583	海能达	6,300	52,983.00	0.05
457	000060	中金岭南	12,300	52,890.00	0.05
458	000732	泰禾集团	8,600	52,890.00	0.05
459	600282	南钢股份	15,300	52,785.00	0.05
460	002085	万丰奥威	7,500	52,500.00	0.05
461	000738	航发控制	4,000	52,280.00	0.05
462	002603	以岭药业	4,200	52,206.00	0.05
463	000039	中集集团	5,300	52,046.00	0.05

					例 (%)
1	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	1.82
2	688300	联瑞新材	3,164	126,053.76	0.12
3	688081	兴图新科	3,101	87,479.21	0.08
4	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
5	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.02
6	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01

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	601318	中国平安	11,281,927.89	17.38
2	600519	贵州茅台	7,473,823.84	11.51
3	600036	招商银行	5,248,135.70	8.09
4	000651	格力电器	3,874,230.00	5.97
5	000333	美的集团	3,791,016.00	5.84
6	000858	五粮液	3,612,212.00	5.57
7	600690	海尔智家	3,440,502.45	5.30
8	601166	兴业银行	3,016,914.00	4.65
9	600276	恒瑞医药	2,942,506.68	4.53
10	300498	温氏股份	2,516,825.00	3.88
11	000001	平安银行	2,137,931.69	3.29
12	003816	中国广核	2,002,522.74	3.09
13	600887	伊利股份	1,988,991.00	3.06
14	600030	中信证券	1,960,921.67	3.02
15	600900	长江电力	1,829,982.15	2.82
16	002415	海康威视	1,828,897.00	2.82
17	000002	万科A	1,801,525.00	2.78
18	600016	民生银行	1,638,063.00	2.52

19	601328	交通银行	1,630,866.00	2.51
20	600000	浦发银行	1,449,332.88	2.23
21	002475	立讯精密	1,426,159.26	2.20
22	601288	农业银行	1,343,178.00	2.07
23	600837	海通证券	1,341,349.00	2.07
24	601398	工商银行	1,304,167.00	2.01
25	300059	东方财富	1,298,855.00	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。

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	601318	中国平安	10,730,413.20	16.53
2	600519	贵州茅台	6,886,113.16	10.61
3	600036	招商银行	5,131,771.00	7.91
4	000333	美的集团	4,344,996.44	6.69
5	000651	格力电器	4,053,208.15	6.24
6	000858	五粮液	3,463,843.00	5.34
7	600690	海尔智家	3,459,543.00	5.33
8	601166	兴业银行	3,040,468.00	4.68
9	600276	恒瑞医药	2,728,991.54	4.20
10	600887	伊利股份	2,063,451.00	3.18
11	600030	中信证券	2,019,070.05	3.11
12	000001	平安银行	1,986,420.00	3.06
13	688111	金山办公	1,943,812.31	2.99
14	000002	万科A	1,873,389.74	2.89
15	002415	海康威视	1,764,922.39	2.72
16	600016	民生银行	1,624,474.00	2.50
17	601328	交通银行	1,602,420.00	2.47
18	300498	温氏股份	1,577,280.00	2.43

19	600837	海通证券	1,349,469.00	2.08
20	600000	浦发银行	1,343,841.00	2.07
21	000725	京东方 A	1,342,189.00	2.07
22	600900	长江电力	1,320,269.99	2.03
23	601288	农业银行	1,313,723.00	2.02
24	002475	立讯精密	1,307,612.98	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	205,238,543.16
卖出股票收入(成交)总额	190,940,925.78

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,843,725.00	1.69
	其中:政策性金融债	1,843,725.00	1.69
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	1,843,725.00	1.69

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	018007	国开1801	18,300	1,843,725.00	1.69

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
IF2006	IF2006	1	1,234,920.00	19,860.00	-
公允价值变动总额合计(元)					19,860.00
股指期货投资本期收益(元)					253,223.31
股指期货投资本期公允价值变动(元)					66,660.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内持有少量股指期货合约，主要是为了进行多头套保，应对大额申赎和方便流动性管理。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，未出现基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	177,463.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,480.30
5	应收申购款	62,677.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	268,621.16

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	003816	中国广核	1,987,241.74	1.82	新股锁定
2	688300	联瑞新材	126,053.76	0.12	新股锁定
3	688081	兴图新科	87,479.21	0.08	新发流通受限

§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 MSCI 中国 A 股国际指数 A	1,652	50,310.35	51,607,181.81	62.09%	31,505,520.44	37.91%
创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数 C	639	24,924.77	7,863,591.82	49.37%	8,063,336.40	50.63%
合计	2,216	44,692.97	59,470,773.63	60.05%	39,568,856.84	39.95%

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MSCI中国A股国际指数A	123,064.01	0.15%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	28,398.45	0.18%
	合计	151,462.46	0.15%

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MSCI中国A股国际指数A	0~10
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	0
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0
	合计	0

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	10,000,900.09	10.10%	10,000,900.09	10.10%	36月
基金管理人高级管理人员	14,939.19	0.02%	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	10,015,839.28	10.12%	10,000,900.09	10.10%	36月

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	55,960,583.31	12,417,879.67
本报告期期初基金份额总额	63,735,597.38	18,571,394.88
本报告期基金总申购份额	81,545,367.59	56,997,500.10
减：本报告期基金总赎回份额	62,168,262.72	59,641,966.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	83,112,702.25	15,926,928.22

§ 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30,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为2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	119,514,467.80	30.69%	86,365.88	47.51%	-
招商证券	2	77,331,769.01	19.86%	32,760.94	18.02%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	288,068.00	0.07%	95.42	0.05%	-
长江证券	2	101,570,292.03	26.09%	33,096.36	18.21%	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	90,666,403.29	23.29%	29,468.96	16.21%	-

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	8,658,831.97	73.54%	6,300,000.00	15.79%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	33,600,000.00	84.21%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	3, 115, 221. 30	26. 46%	-	-	-	-	-
--------	-----------------	---------	---	---	---	---	---

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MSCI中国A股国际指数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
2	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	2019-02-26
3	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(2019年第1号)招募说明书(更新)	公司官网、中国证券报	2019-03-22
4	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2019年第1号)	公司官网、中国证券报	2019-03-22
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与中投证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2019-03-28
6	创金合信MSCI中国A股国际指数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
7	创金合信MSCI中国A股国际指数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
8	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2019-04-04
9	创金合信MSCI中国A股国际指数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

10	创金合信MSCI中国A股国际指数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
11	创金合信MSCI中国A股国际指数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
12	创金合信MSCI中国A股国际指数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
13	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(2019年第2号)招募说明书(更新)	公司官网、中国证券报	2019-09-20
14	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2019年第2号)	公司官网、中国证券报	2019-09-20
15	创金合信MSCI中国A股国际指数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
16	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报	2019-11-05
17	创金合信MSCI中国A股国际指数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
18	创金合信MSCI中国A股国际指数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
19	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托	公司官网、中国证券报	2019-11-29

	管协议（2019年11月修订）		
--	-----------------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20191030 - 20191114, 20191218 - 20191225	0.00	28,811,947.75	10,000,000.00	18,811,947.75	18.99%
	2	20191224 - 20191231	0.00	25,675,879.46	0.00	25,675,879.46	25.92%

产品特有风险

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：

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。

2、大额赎回风险

- (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；
- (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；
- (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算

等风险。

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。

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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信MSCI中国A股国际指数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