

创金合信中证 1000 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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04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	14
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	16
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	17
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
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	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
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	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	116
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	116
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	117
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	117
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	117
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	117

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	117
8.12 投资组合报告附注.....	118
§9 基金份额持有人信息.....	118
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	118
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	119
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.....	119
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	120
§10 开放式基金份额变动.....	120
§11 重大事件揭示.....	121
11.1 基金份额持有人大会决议.....	121
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.....	121
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	121
11.4 基金投资策略的改变.....	121
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	121
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.....	121
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	121
11.8 其他重大事件.....	122
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	125
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.....	125
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	126
§13 备查文件目录.....	126
13.1 备查文件目录.....	126
13.2 存放地点.....	126
13.3 查阅方式.....	126

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证1000增强	
基金主代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	130,256,604.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份额总额	48,955,016.06份	81,301,588.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	贺倩
	联系电话	0755-23838908	010-66060069
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95599
传真		0755-25832571	010-68121816
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518000	100031
法定代表人		刘学民	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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《证券时报》变更为《上海证券报》。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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1000 增强A	创金合信 中证1000 增强C	创金合信 中证1000 增强A	创金合信 中证1000 增强C	创金合信 中证1000 增强A	创金合信 中证1000 增强C
本期已实 现收益	6,568,43 2.75	9,443,48 6.94	-14,374, 051.88	-8,398,1 36.00	-4,982,1 42.06	-213,41 8.70
本期利润	9,077,17 3.65	11,346,5 99.46	-14,820, 436.86	-8,434,0 91.20	-6,204,6 41.10	-188,99 7.31
加权平均 基金份额 本期利润	0.1937	0.1843	-0.2546	-0.2978	-0.0309	-0.0272
本期加权 平均净值 利润率	20.63%	19.63%	-27.55%	-34.31%	-3.16%	-2.78%
本期基金 份额净值 增长率	36.62%	35.76%	-23.70%	-23.76%	-1.31%	-1.34%
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	-5,739,0 02.28	-10,137, 361.44	-8,356,3 96.21	-9,899,9 25.48	-5,662,2 46.40	-279,08 3.96
期末可供 分配基金 份额利润	-0.1172	-0.1247	-0.3093	-0.3102	-0.0269	-0.0272

期末基金资产净值	49,794,046.13	82,076,231.84	20,116,169.03	23,730,901.58	205,305,541.73	10,001,754.96
期末基金份额净值	1.0171	1.0095	0.7445	0.7436	0.9757	0.9754
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	1.71%	0.95%	-25.55%	-25.64%	-2.43%	-2.46%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证1000增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.43%	0.91%	6.10%	0.96%	1.33%	-0.05%
过去六个月	8.20%	1.10%	4.46%	1.12%	3.74%	-0.02%
过去一年	36.62%	1.41%	24.51%	1.49%	12.11%	-0.08%
过去三年	2.87%	1.29%	-32.64%	1.34%	35.51%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.71%	1.28%	-33.52%	1.33%	35.23%	-0.05%

创金合信中证1000增强C

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

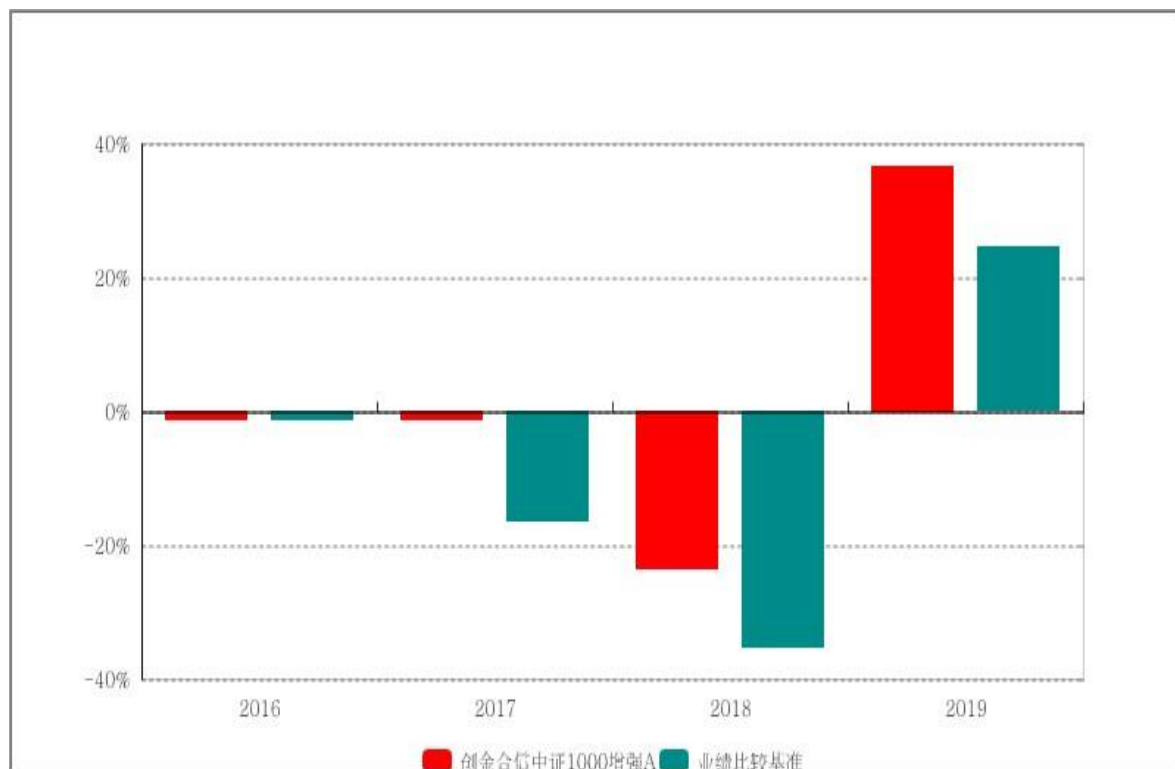
				④		
过去三个月	7.36%	0.91%	6.10%	0.96%	1.26%	-0.05%
过去六个月	7.99%	1.10%	4.46%	1.12%	3.53%	-0.02%
过去一年	35.76%	1.41%	24.51%	1.49%	11.25%	-0.08%
过去三年	2.11%	1.29%	-32.64%	1.34%	34.75%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.95%	1.28%	-33.52%	1.33%	34.47%	-0.05%

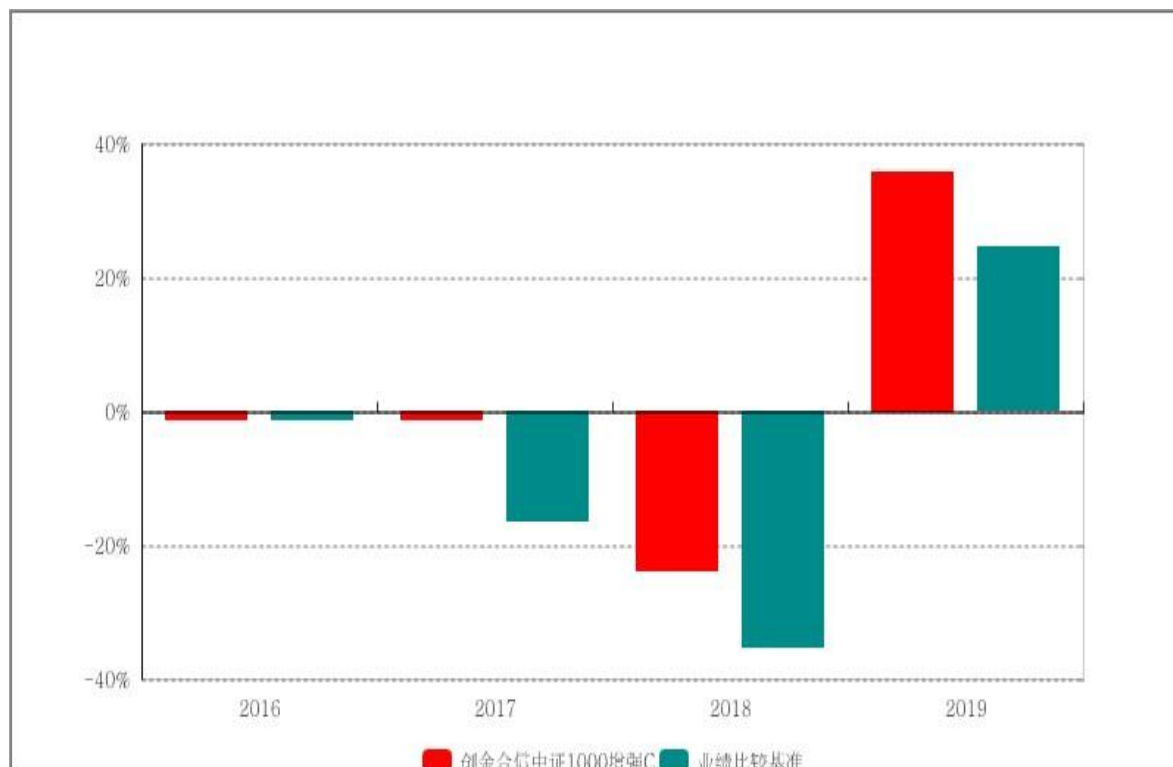
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 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		
程志田	本基金基金经理	2016-12-22	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)。
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

所有投资对象的投资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20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

受中美贸易摩擦的影响，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。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，基建方面水泥量价齐升，工程机械销量超预期增长。但是融资环境改善偏慢，企业债务违约比例依然偏高，个股选择的风险依然很高。

市场方面，中证1000指数以小市值股票为主，信息技术、医疗保健行业涨幅居前，能源、地产及公用事业行业表现不佳。

本基金以中证1000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1000增强A基金份额净值为1.0171元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为36.62%，同期业绩比较基准收益率为24.51%；截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为1.0095元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为35.76%，同期业绩比较基准收益率为24.51%。

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。一季度经济压力较大，今年房地产调控料将持续。为了对冲由此带来的经济下行压力，政策宽松幅度可能加大，流动性将保持宽松。目前A股的估值仍在中枢以下。中美贸易摩擦的影响正在减弱，国际主流指数显著提高了A股所占权重，外资流入的趋势有望持续，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

本基金为发起式基金, 于2019年12月22日成立满三年并继续存续。本基金成立满三年后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

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人—创金合信基金管理有限公司2019年1月1日至2019年12月31日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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24949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1000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1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“创金合信中证1000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1000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	<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中证1000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	

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>创金合信中证1000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1000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1000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1000增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。(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>

	见。 (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。 (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1000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1000增强基金不能持续经营。 (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。
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1000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	4,113,187.12	801,785.36
结算备付金		3,266,111.05	696,932.85
存出保证金		305,841.74	33,180.97
交易性金融资产	7.4.7.2	124,131,782.84	42,451,516.03
其中：股票投资		120,700,071.84	40,222,935.23
基金投资		-	-
债券投资		3,431,711.00	2,228,580.80
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	61,226.73	61,785.93
应收股利		-	-
应收申购款		617,220.83	125,567.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		132,495,370.31	44,170,768.92
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		500.00	-
应付赎回款		155,149.91	25,546.94
应付管理人报酬		88,677.70	29,990.46
应付托管费		16,627.08	5,623.23
应付销售服务费		13,439.32	3,993.92

应付交易费用	7.4.7.7	230,478.84	88,543.41
应交税费		-	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	120,219.49	170,000.00
负债合计		625,092.34	323,698.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	130,256,604.33	58,934,800.32
未分配利润	7.4.7.10	1,613,673.64	-15,087,729.71
所有者权益合计		131,870,277.97	43,847,070.61
负债和所有者权益总计		132,495,370.31	44,170,768.92

注：报告截止日2019年12月31日，基金份额总额130,256,604.33份，其中下属A类基金份额48,955,016.06份，C类基金份额81,301,588.27份。下属A类基金份额净值1.0171元，C类基金份额净值1.0095元。

7.2 利润表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年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
一、收入		24,234,910.00	-18,251,396.46
1. 利息收入		178,531.95	184,686.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	53,125.66	47,693.62
债券利息收入		125,406.29	135,838.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,154.51

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,942,072.94	-18,057,855.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	17,845,166.64	-18,510,212.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-15,574.88	21,106.66
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	-99,326.60	-
股利收益	7.4.7.15	1,211,807.78	431,250.14
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,411,853.42	-482,340.18
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	702,451.69	104,112.56
减：二、费用		3,811,136.89	5,003,131.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	803,158.98	630,834.22
2. 托管费	7.4.10.2. 2	150,592.34	118,281.34
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	113,519.21	48,739.29
4. 交易费用	7.4.7.18	2,584,934.53	3,977,743.62
5. 利息支出		2,468.37	21,729.33
其中：卖出回购金融资产 支出		2,468.37	21,729.33
6. 税金及附加		581.77	0.72
7. 其他费用	7.4.7.19	155,881.69	205,803.08
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		20,423,773.11	-23,254,528.06

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,423,773.11	-23,254,528.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年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）	58,934,800.32	-15,087,729.71	43,847,070.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,423,773.11	20,423,773.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	71,321,804.01	-3,722,369.76	67,599,434.25
其中：1. 基金申购款	307,113,567.24	-13,705,841.09	293,407,726.15
2. 基金赎回款	-235,791,763.23	9,983,471.33	-225,808,291.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	130,256,604.33	1,613,673.64	131,870,277.97

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)	220,669,622.69	-5,362,326.00	215,307,296.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,254,528.06	-23,254,528.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-161,734,822.37	13,529,124.35	-148,205,698.02
其中：1. 基金申购款	99,011,771.99	-10,059,264.86	88,952,507.13
2. 基金赎回款	-260,746,594.36	23,588,389.21	-237,158,205.15
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)	58,934,800.32	-15,087,729.71	43,847,070.61

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1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1918号《关于准予创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,115,380.08元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1553号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,115,717.42份基金份额,其中认购资金利息折合337.34份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,333.36份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中证1000指数收益率 \times 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) \times 5%。

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1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注

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外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外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和债券投资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	4,113,187.12	801,785.36
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	4,113,187.12	801,785.36

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		118,090,688.49	120,700,071.84	2,609,383.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,432,682.18	3,431,711.00	-971.18
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,432,682.18	3,431,711.00	-971.18
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		121,523,370.67	124,131,782.84	2,608,412.17
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		42,013,085.28	40,222,935.23	-1,790,150.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,228,832.00	2,228,580.80	-251.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,228,832.00	2,228,580.80	-251.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		44,241,917.28	42,451,516.03	-1,790,401.25

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	2,086,800.00	-	-	-

股指期货	2,086,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,086,800.00	-	-	-
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	4,994.97	179.49
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,142.65	344.85
应收债券利息	54,062.49	61,245.20
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	26.62	16.39
合计	61,226.73	61,785.93

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	230,478.84	88,543.41
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	230,478.84	88,543.41

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	219.49	-
预提费用	120,000.00	170,000.00
合计	120,219.49	170,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 创金合信中证1000增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000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	27,019,851.67	27,019,851.67

本期申购	89,886,029.33	89,886,029.33
本期赎回（以“-”号填列）	-67,950,864.94	-67,950,864.94
本期末	48,955,016.06	48,955,016.06

7.4.7.9.2 创金合信中证1000增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,914,948.65	31,914,948.65
本期申购	217,227,537.91	217,227,537.91
本期赎回（以“-”号填列）	-167,840,898.29	-167,840,898.29
本期末	81,301,588.27	81,301,588.27

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1000增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,356,396.21	1,452,713.57	-6,903,682.64
本期利润	6,568,432.75	2,508,740.90	9,077,173.65
本期基金份额交易产生的变动数	-3,951,038.82	2,616,577.88	-1,334,460.94
其中：基金申购款	-16,290,430.88	11,576,661.81	-4,713,769.07
基金赎回款	12,339,392.06	-8,960,083.93	3,379,308.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,739,002.28	6,578,032.35	839,030.07

7.4.7.10.2 创金合信中证1000增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(创金合信中证1000增强C)			
上年度末	-9,899,925.48	1,715,878.41	-8,184,047.07
本期利润	9,443,486.94	1,903,112.52	11,346,599.46
本期基金份额交易产生的变动数	-9,680,922.90	7,293,014.08	-2,387,908.82
其中：基金申购款	-38,276,909.28	29,284,837.26	-8,992,072.02
基金赎回款	28,595,986.38	-21,991,823.18	6,604,163.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,137,361.44	10,912,005.01	774,643.57

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	26,938.67	13,874.01
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	25,456.07	32,143.51
其他	730.92	1,676.10
合计	53,125.66	47,693.62

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	1,312,510,399.90	2,079,764,895.29
减：卖出股票成本总额	1,294,665,233.26	2,098,275,107.77
买卖股票差价收入	17,845,166.64	-18,510,212.48

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	-15,574.88	21,106.66
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	-15,574.88	21,106.66

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	10,847,112.22	14,231,578.87
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	10,537,264.76	13,963,322.70
减：应收利息总额	325,422.34	247,149.51
买卖债券差价收入	-15,574.88	21,106.66

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	-99,326.60	-
	-	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	1,211,807.78	431,250.14
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,211,807.78	431,250.14

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	4,398,813.42	-482,340.18
——股票投资	4,399,533.40	-504,328.18
——债券投资	-719.98	21,988.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	13,040.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	13,040.00	-
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	4,411,853.42	-482,340.18

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	701,529.78	101,772.28
转换费收入	921.91	2,340.28
合计	702,451.69	104,112.56

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	2,582,632.10	3,977,743.62
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	2,302.43	-
合计	2,584,934.53	3,977,743.62

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 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
审计费用	30,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	100,000.00
汇划手续费	5,881.69	5,803.08

指数使用费	40,000.00	40,000.00
合计	155,881.69	205,803.08

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
农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	2,199,497,419.58	82.05%	3,291,124,477.15	81.85%

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	8,343,484.89	56.05%	13,400,879.65	83.27%

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	11,000,000.00	44.18%	78,500,000.00	75.85%

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	923,893.77	89.75%	230,478.84	100.00%
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	1,381,218.55	89.63%	-	-

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	803,158.98	630,834.22
其中：支付销售机构的客户维护费	214,224.73	89,288.17

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

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	150,592.34	118,281.34

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

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1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信直销	0.00	78,966.85	78,966.85
合计	0.00	78,966.85	78,966.85
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1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信直销	0.00	32,638.78	32,638.78
合计	0.00	32,638.78	32,638.78

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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1000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（2016年12月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.21%	18.51%

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年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（2016年12月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.15%	15.67%

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
中国农业银行股份有限公司	4,113,187.12	26,938.67	801,785.36	13,874.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业存款利率计息。

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	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	估值总额	
688078	龙软科技	2019-12-20	2020-06-30	新股锁定	21.59	41.95	2,248	48,534.32	94,303.60	-
688089	嘉必优	2019-12-12	2020-06-19	新股锁定	23.90	31.67	2,274	54,348.60	72,017.58	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新发流通受限	28.21	28.21	1,892	53,373.32	53,373.32	-
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	15,600	610,502.00	614,484.00	-
600966	博汇纸业	2019-12-31	重大事项停牌	5.31	2020-01-02	5.84	27,000	126,783.42	143,370.00	-

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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

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	560,336.00	-
合计	560,336.00	-

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	-	28,944.80
未评级	2,871,375.00	2,199,636.00
合计	2,871,375.00	2,228,580.80

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0.75%。

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127,932,126.74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	4,113,187.12	-	-	-	4,113,187.12
结算备付金	3,266,111.05	-	-	-	3,266,111.05
存出保证金	305,841.74	-	-	-	305,841.74
交易性金融资产	3,431,711.00	-	-	120,700,071.84	124,131,782.84
应收利息	-	-	-	61,226.73	61,226.73
应收申购款	-	-	-	617,220.83	617,220.83
资产总计	11,116,850.91	-	-	121,378,519.40	132,495,370.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	500.00	500.00
应付赎回款	-	-	-	155,149.91	155,149.91
应付管理人报酬	-	-	-	88,677.70	88,677.70
应付托管费	-	-	-	16,627.08	16,627.08
应付销售服务费	-	-	-	13,439.32	13,439.32

应付交易费用	-	-	-	230,478.84	230,478.84
其他负债	-	-	-	120,219.49	120,219.49
负债总计	-	-	-	625,092.34	625,092.34
利率敏感度缺口	11,116,850.91	-	-	120,753,427.06	131,870,277.97
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	801,785.36	-	-	-	801,785.36
结算备付金	696,932.85	-	-	-	696,932.85
存出保证金	33,180.97	-	-	-	33,180.97
交易性金融资产	2,199,636.00	-	28,944.80	40,222,935.23	42,451,516.03
应收利息	-	-	-	61,785.93	61,785.93
应收申购款	-	-	-	125,567.78	125,567.78
资产总计	3,731,535.18	-	28,944.80	40,410,288.94	44,170,768.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,546.94	25,546.94
应付管理人报酬	-	-	-	29,990.46	29,990.46
应付托管费	-	-	-	5,623.23	5,623.23
应付销售服务	-	-	-	3,993.92	3,993.92

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

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

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2.60%(2018年12月31日：5.08%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日：同)。

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	120,700,071.84	91.53	40,222,935.23	91.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	120,700,071.84	91.53	40,222,935.23	91.73

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%	6,258,573.49	2,016,052.84
	比较基准下降5%	-6,258,573.49	-2,016,052.84

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119,715,945.30元，属于第二层次的余额为4,415,837.54元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次40,239,864.03元，第二层次2,211,652.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年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) 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	120,700,071.84	91.10
	其中：股票	120,700,071.84	91.10
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	3,431,711.00	2.59
	其中：债券	3,431,711.00	2.59
	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	7,379,298.17	5.57
8	其他各项资产	984,289.30	0.74
9	合计	132,495,370.31	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	1,022,650.00	0.78
B	采矿业	1,850,548.88	1.40
C	制造业	64,390,563.42	48.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,895,504.11	1.44
E	建筑业	3,150,272.07	2.39
F	批发和零售业	3,607,623.70	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	1,619,391.20	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,061,266.81	9.90
J	金融业	998,343.00	0.76
K	房地产业	4,105,029.00	3.11
L	租赁和商务服务业	710,714.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	805,323.59	0.61

N	水利、环境和公共设施管理业	2,981,690.00	2.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,379,396.00	1.05
S	综合	845,319.44	0.64
	合计	102,423,635.22	77.67

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	417,120.00	0.32
C	制造业	13,355,426.98	10.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	918.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	825,954.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	418,664.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,678,115.60	1.27
J	金融业	745,096.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	825,210.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	2,428.00	0.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	926.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	18,276,436.62	13.86

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	600323	瀚蓝环境	61,500	1,078,710.00	0.82
2	600803	新奥股份	97,700	1,039,528.00	0.79
3	600226	瀚叶股份	323,100	1,014,534.00	0.77
4	603678	火炬电子	44,200	1,013,948.00	0.77
5	603308	应流股份	67,300	1,010,173.00	0.77
6	601222	林洋能源	207,200	1,006,992.00	0.76
7	601163	三角轮胎	65,600	1,003,680.00	0.76
8	603118	共进股份	88,500	994,740.00	0.75
9	600308	华泰股份	213,500	979,965.00	0.74
10	603605	珀莱雅	11,100	977,355.00	0.74
11	600129	太极集团	85,900	976,683.00	0.74
12	600261	阳光照明	203,099	964,720.25	0.73
13	603508	思维列控	16,200	958,716.00	0.73
14	603367	辰欣药业	56,600	936,730.00	0.71
15	603803	瑞斯康达	70,900	914,610.00	0.69
16	603387	基蛋生物	39,560	911,858.00	0.69
17	600571	信雅达	95,500	910,115.00	0.69
18	603169	兰石重装	155,400	907,536.00	0.69

19	600533	栖霞建设	270,800	907,180.00	0.69
20	600619	海立股份	109,800	905,850.00	0.69
21	600295	鄂尔多斯	100,373	905,364.46	0.69
22	600491	龙元建设	123,600	903,516.00	0.69
23	601116	三江购物	69,600	898,536.00	0.68
24	600133	东湖高新	164,100	879,576.00	0.67
25	600242	中昌数据	110,000	865,700.00	0.66
26	603013	亚普股份	56,300	864,768.00	0.66
27	603383	顶点软件	11,300	824,561.00	0.63
28	600622	光大嘉宝	211,100	823,290.00	0.62
29	600184	光电股份	72,500	822,150.00	0.62
30	600720	祁连山	62,700	786,885.00	0.60
31	603180	金牌厨柜	11,500	767,970.00	0.58
32	601858	中国科传	63,800	699,248.00	0.53
33	300571	平治信息	12,300	675,024.00	0.51
34	600172	黄河旋风	230,052	669,451.32	0.51
35	600668	尖峰集团	42,300	668,340.00	0.51
36	601519	大智慧	82,700	652,503.00	0.49
37	600587	新华医疗	45,366	647,826.48	0.49
38	601636	旗滨集团	115,700	635,193.00	0.48
39	600230	沧州大化	59,600	615,668.00	0.47
40	603603	博天环境	66,700	612,306.00	0.46
41	600604	市北高新	68,000	602,480.00	0.46
42	601330	绿色动力	56,100	596,343.00	0.45
43	601908	京运通	177,300	531,900.00	0.40
44	601020	华钰矿业	55,500	506,715.00	0.38
45	603583	捷昌驱动	11,100	494,283.00	0.37
46	300271	华宇软件	19,100	485,140.00	0.37
47	603081	大丰实业	29,600	482,776.00	0.37
48	300661	圣邦股份	1,800	454,464.00	0.34
49	603920	世运电路	23,100	440,979.00	0.33

50	603456	九洲药业	31,300	436,322.00	0.33
51	603008	喜临门	28,100	434,707.00	0.33
52	002396	星网锐捷	11,700	416,052.00	0.32
53	600702	舍得酒业	13,100	393,131.00	0.30
54	300558	贝达药业	5,904	387,892.80	0.29
55	603368	柳药股份	11,200	376,768.00	0.29
56	300212	易华录	11,200	374,528.00	0.28
57	300326	凯利泰	27,100	367,205.00	0.28
58	600990	四创电子	8,200	365,556.00	0.28
59	300699	光威复材	7,600	345,800.00	0.26
60	600200	江苏吴中	63,668	342,533.84	0.26
61	600529	山东药玻	12,300	339,972.00	0.26
62	603588	高能环境	34,800	330,600.00	0.25
63	300496	中科创达	7,105	320,719.70	0.24
64	002123	梦网集团	16,600	317,558.00	0.24
65	600797	浙大网新	31,100	313,177.00	0.24
66	002458	益生股份	10,600	300,510.00	0.23
67	300369	绿盟科技	16,500	298,980.00	0.23
68	600851	海欣股份	36,800	295,872.00	0.22
69	300226	上海钢联	3,800	295,640.00	0.22
70	600550	保变电气	93,452	287,832.16	0.22
71	002036	联创电子	16,900	287,469.00	0.22
72	600873	梅花生物	64,000	284,800.00	0.22
73	600635	大众公用	57,100	280,361.00	0.21
74	002675	东诚药业	16,600	267,426.00	0.20
75	300482	万孚生物	5,100	264,027.00	0.20
76	600459	贵研铂业	17,400	262,740.00	0.20
77	603026	石大胜华	7,500	262,650.00	0.20
78	603305	旭升股份	7,700	261,415.00	0.20
79	603660	苏州科达	23,700	260,700.00	0.20
80	002402	和而泰	20,100	259,893.00	0.20

81	000735	罗牛山	25,400	258,064.00	0.20
82	002035	华帝股份	19,200	257,664.00	0.20
83	300118	东方日升	18,600	257,610.00	0.20
84	600641	万业企业	13,700	257,560.00	0.20
85	600252	中恒集团	78,800	256,888.00	0.19
86	002648	卫星石化	15,700	256,695.00	0.19
87	300747	锐科激光	2,150	253,270.00	0.19
88	601058	赛轮轮胎	55,700	248,979.00	0.19
89	600864	哈投股份	30,700	247,442.00	0.19
90	600093	易见股份	17,600	245,696.00	0.19
91	002100	天康生物	18,752	239,650.56	0.18
92	600601	方正科技	64,700	236,802.00	0.18
93	600812	华北制药	24,000	236,160.00	0.18
94	300451	创业慧康	13,100	235,014.00	0.18
95	300595	欧普康视	4,800	227,184.00	0.17
96	300476	胜宏科技	13,800	225,078.00	0.17
97	300463	迈克生物	8,200	221,154.00	0.17
98	600711	盛屯矿业	40,800	215,832.00	0.16
99	600206	有研新材	17,500	213,500.00	0.16
100	600320	振华重工	58,800	213,444.00	0.16
101	000672	上峰水泥	11,600	212,164.00	0.16
102	000917	电广传媒	31,400	211,636.00	0.16
103	300036	超图软件	10,600	211,258.00	0.16
104	601375	中原证券	39,400	211,184.00	0.16
105	300474	景嘉微	3,600	210,888.00	0.16
106	600305	恒顺醋业	13,800	210,450.00	0.16
107	300294	博雅生物	6,700	209,241.00	0.16
108	600559	老白干酒	18,588	208,929.12	0.16
109	603068	博通集成	2,300	207,161.00	0.16
110	000710	贝瑞基因	5,600	204,960.00	0.16
111	300078	思创医惠	16,400	201,392.00	0.15

112	600986	科达股份	40,600	201,376.00	0.15
113	600756	浪潮软件	9,600	198,528.00	0.15
114	603222	济民制药	3,600	198,000.00	0.15
115	300322	硕贝德	9,600	196,416.00	0.15
116	603609	禾丰牧业	16,600	196,378.00	0.15
117	603345	安井食品	3,300	196,053.00	0.15
118	300170	汉得信息	20,100	194,769.00	0.15
119	002568	百润股份	7,400	194,398.00	0.15
120	600667	太极实业	23,800	193,018.00	0.15
121	600868	梅雁吉祥	55,900	192,855.00	0.15
122	600750	江中药业	15,286	191,533.58	0.15
123	002547	春兴精工	23,300	191,526.00	0.15
124	600621	华鑫股份	12,500	191,375.00	0.15
125	000034	神州数码	9,600	190,560.00	0.14
126	600850	华东电脑	7,500	190,200.00	0.14
127	300487	蓝晓科技	5,100	186,150.00	0.14
128	002292	奥飞娱乐	18,700	185,691.00	0.14
129	002389	航天彩虹	16,700	185,370.00	0.14
130	000933	神火股份	33,600	184,128.00	0.14
131	000683	远兴能源	80,900	183,643.00	0.14
132	300458	全志科技	5,700	182,343.00	0.14
133	002697	红旗连锁	24,100	181,955.00	0.14
134	600330	天通股份	22,620	181,864.80	0.14
135	600612	老凤祥	3,800	180,918.00	0.14
136	603869	新智认知	15,000	178,800.00	0.14
137	300038	数知科技	20,723	178,632.26	0.14
138	300724	捷佳伟创	4,700	178,083.00	0.14
139	300348	长亮科技	8,500	177,820.00	0.13
140	603737	三棵树	2,200	177,430.00	0.13
141	600984	建设机械	17,100	176,643.00	0.13
142	600131	国网信通	8,900	176,398.00	0.13

143	600185	格力地产	36,400	176,176.00	0.13
144	603708	家家悦	7,200	175,248.00	0.13
145	600072	中船科技	13,000	173,940.00	0.13
146	002481	双塔食品	21,900	173,886.00	0.13
147	002851	麦格米特	8,350	173,012.00	0.13
148	600771	广誉远	10,200	172,992.00	0.13
149	002234	民和股份	5,400	171,774.00	0.13
150	000555	神州信息	11,584	171,559.04	0.13
151	300130	新国都	9,700	171,011.00	0.13
152	300502	新易盛	4,200	168,588.00	0.13
153	600422	昆药集团	15,700	168,461.00	0.13
154	600483	福能股份	18,300	168,360.00	0.13
155	002446	盛路通信	18,500	167,425.00	0.13
156	300685	艾德生物	2,500	167,050.00	0.13
157	002413	雷科防务	30,500	165,920.00	0.13
158	600596	新安股份	16,700	164,328.00	0.12
159	600562	国睿科技	11,300	162,042.00	0.12
160	600337	美克家居	36,500	161,695.00	0.12
161	300085	银之杰	10,400	160,992.00	0.12
162	600363	联创光电	10,500	160,545.00	0.12
163	600284	浦东建设	25,200	160,020.00	0.12
164	600764	中国海防	5,600	159,376.00	0.12
165	600517	置信电气	19,200	158,208.00	0.12
166	600993	马应龙	9,030	157,934.70	0.12
167	600546	山煤国际	22,500	157,050.00	0.12
168	300602	飞荣达	3,700	156,880.00	0.12
169	600318	新力金融	22,400	156,800.00	0.12
170	600063	皖维高新	40,000	156,800.00	0.12
171	002531	天顺风能	24,800	156,736.00	0.12
172	600602	云赛智联	19,000	156,560.00	0.12
173	600775	南京熊猫	15,400	156,464.00	0.12

174	000697	炼石航空	14,600	154,760.00	0.12
175	600831	广电网络	16,700	154,642.00	0.12
176	601588	北辰实业	47,100	154,488.00	0.12
177	000921	海信家电	12,500	154,125.00	0.12
178	603693	江苏新能	15,100	153,718.00	0.12
179	603363	傲农生物	9,700	153,648.00	0.12
180	601677	明泰铝业	13,300	153,349.00	0.12
181	600110	诺德股份	32,700	153,036.00	0.12
182	600456	宝钛股份	6,300	153,027.00	0.12
183	002649	博彦科技	15,400	152,768.00	0.12
184	600378	昊华科技	7,900	152,549.00	0.12
185	300292	吴通控股	30,100	152,005.00	0.12
186	000049	德赛电池	3,700	150,738.00	0.11
187	300377	赢时胜	13,100	150,519.00	0.11
188	600360	华微电子	22,800	150,252.00	0.11
189	600503	华丽家族	47,200	150,096.00	0.11
190	002705	新宝股份	9,100	150,059.00	0.11
191	000810	创维数字	12,500	149,875.00	0.11
192	603399	吉翔股份	11,100	149,850.00	0.11
193	601011	宝泰隆	33,200	149,732.00	0.11
194	600326	西藏天路	20,400	149,532.00	0.11
195	603638	艾迪精密	4,900	149,254.00	0.11
196	600789	鲁抗医药	20,700	149,247.00	0.11
197	300232	洲明科技	15,000	148,650.00	0.11
198	601918	新集能源	45,800	148,392.00	0.11
199	600761	安徽合力	15,204	147,934.92	0.11
200	000931	中关村	15,000	147,150.00	0.11
201	002657	中科金财	7,900	146,466.00	0.11
202	300236	上海新阳	5,250	145,267.50	0.11
203	600742	一汽富维	12,000	145,080.00	0.11
204	601567	三星医疗	19,500	144,300.00	0.11

205	000733	振华科技	8,400	144,060.00	0.11
206	600966	博汇纸业	27,000	143,370.00	0.11
207	600269	赣粤高速	34,500	142,485.00	0.11
208	002777	久远银海	3,900	141,960.00	0.11
209	002022	科华生物	12,100	141,328.00	0.11
210	603323	苏农银行	26,500	140,185.00	0.11
211	601666	平煤股份	34,800	139,896.00	0.11
212	000708	中信特钢	6,100	139,873.00	0.11
213	300223	北京君正	1,600	139,440.00	0.11
214	002318	久立特材	14,800	138,824.00	0.11
215	600988	赤峰黄金	27,500	138,325.00	0.10
216	002251	步步高	15,200	138,320.00	0.10
217	603027	千禾味业	6,500	138,190.00	0.10
218	002798	帝欧家居	5,500	137,775.00	0.10
219	600783	鲁信创投	8,700	136,938.00	0.10
220	600846	同济科技	14,700	136,857.00	0.10
221	601929	吉视传媒	64,200	136,746.00	0.10
222	600624	复旦复华	14,100	136,629.00	0.10
223	300327	中颖电子	5,300	136,528.00	0.10
224	002626	金达威	7,000	136,500.00	0.10
225	600366	宁波韵升	20,400	135,864.00	0.10
226	300735	光弘科技	5,200	135,616.00	0.10
227	002639	雪人股份	15,900	135,468.00	0.10
228	600449	宁夏建材	12,100	135,036.00	0.10
229	603596	伯特利	6,000	135,000.00	0.10
230	600210	紫江企业	35,800	134,966.00	0.10
231	002117	东港股份	10,800	134,460.00	0.10
232	600108	亚盛集团	46,100	134,151.00	0.10
233	600116	三峡水利	17,629	133,804.11	0.10
234	600285	羚锐制药	13,400	132,660.00	0.10
235	600936	广西广电	34,500	132,480.00	0.10

236	600057	厦门象屿	31,800	131,970.00	0.10
237	002530	金财互联	11,400	131,898.00	0.10
238	002611	东方精工	31,000	131,750.00	0.10
239	601369	陕鼓动力	19,800	131,670.00	0.10
240	600611	大众交通	32,200	130,732.00	0.10
241	002097	山河智能	22,200	130,536.00	0.10
242	300572	安车检测	2,700	129,816.00	0.10
243	300287	飞利信	33,800	129,792.00	0.10
244	000900	现代投资	29,700	129,492.00	0.10
245	300353	东土科技	10,100	129,482.00	0.10
246	000958	东方能源	22,800	127,224.00	0.10
247	600123	兰花科创	19,400	124,548.00	0.09
248	600502	安徽建工	30,400	123,424.00	0.09
249	600496	精工钢构	42,700	123,403.00	0.09
250	600169	太原重工	52,900	123,257.00	0.09
251	603599	广信股份	8,200	122,918.00	0.09
252	300737	科顺股份	10,800	122,256.00	0.09
253	603606	东方电缆	11,100	121,878.00	0.09
254	600059	古越龙山	14,300	121,693.00	0.09
255	300429	强力新材	7,300	121,691.00	0.09
256	603881	数据港	3,200	121,440.00	0.09
257	002733	雄韬股份	4,500	120,960.00	0.09
258	002617	露笑科技	22,300	120,866.00	0.09
259	300137	先河环保	15,700	120,576.00	0.09
260	600531	豫光金铅	25,700	120,533.00	0.09
261	300406	九强生物	7,400	120,324.00	0.09
262	603718	海利生物	9,400	120,320.00	0.09
263	300298	三诺生物	8,000	119,920.00	0.09
264	300177	中海达	13,400	118,992.00	0.09
265	600175	美都能源	65,200	118,664.00	0.09
266	600736	苏州高新	20,300	118,349.00	0.09

267	000040	东旭蓝天	28,200	117,876.00	0.09
268	002104	恒宝股份	15,300	117,045.00	0.09
269	600020	中原高速	26,500	116,600.00	0.09
270	600681	百川能源	17,000	115,600.00	0.09
271	600708	光明地产	32,800	115,456.00	0.09
272	300047	天源迪科	14,500	115,420.00	0.09
273	002303	美盈森	21,600	114,696.00	0.09
274	600162	香江控股	50,000	114,500.00	0.09
275	601137	博威合金	10,100	113,726.00	0.09
276	300020	银江股份	13,500	113,400.00	0.09
277	300266	兴源环境	32,300	113,373.00	0.09
278	603018	中设集团	11,011	113,303.19	0.09
279	601890	亚星锚链	19,800	113,256.00	0.09
280	601069	西部黄金	7,500	113,250.00	0.09
281	603128	华贸物流	17,900	112,949.00	0.09
282	300366	创意信息	10,900	112,706.00	0.09
283	600103	青山纸业	54,400	112,608.00	0.09
284	002367	康力电梯	14,100	112,095.00	0.09
285	002383	合众思壮	12,000	111,840.00	0.08
286	601010	文峰股份	36,400	111,384.00	0.08
287	603393	新天然气	4,000	111,160.00	0.08
288	603039	泛微网络	1,900	111,150.00	0.08
289	002545	东方铁塔	14,700	110,985.00	0.08
290	002515	金字火腿	20,200	110,292.00	0.08
291	300034	钢研高纳	6,900	110,193.00	0.08
292	300222	科大智能	11,800	110,094.00	0.08
293	603127	昭衍新药	1,900	109,820.00	0.08
294	002474	榕基软件	12,800	109,440.00	0.08
295	002850	科达利	2,400	109,200.00	0.08
296	000969	安泰科技	16,300	108,558.00	0.08
297	600577	精达股份	39,700	108,381.00	0.08

298	600420	现代制药	12,100	108,174.00	0.08
299	300355	蒙草生态	31,700	108,097.00	0.08
300	603113	金能科技	10,000	107,900.00	0.08
301	300043	星辉娱乐	21,000	107,730.00	0.08
302	600552	凯盛科技	18,300	107,604.00	0.08
303	600477	杭萧钢构	38,100	107,442.00	0.08
304	603686	龙马环卫	9,800	107,016.00	0.08
305	002047	宝鹰股份	18,400	106,168.00	0.08
306	600512	腾达建设	37,700	105,937.00	0.08
307	600971	恒源煤电	17,700	105,846.00	0.08
308	000601	韶能股份	19,100	105,814.00	0.08
309	000973	佛塑科技	22,800	105,792.00	0.08
310	600114	东睦股份	12,300	105,534.00	0.08
311	300702	天宇股份	2,100	105,252.00	0.08
312	300198	纳川股份	24,300	104,976.00	0.08
313	600495	晋西车轴	24,900	104,580.00	0.08
314	002668	奥马电器	18,500	104,525.00	0.08
315	002792	通宇通讯	3,900	104,208.00	0.08
316	600197	伊力特	6,500	104,195.00	0.08
317	601700	风范股份	16,100	104,006.00	0.08
318	600978	宜华生活	35,000	103,950.00	0.08
319	002243	通产丽星	6,900	103,500.00	0.08
320	600343	航天动力	11,300	103,395.00	0.08
321	002235	安妮股份	12,000	103,320.00	0.08
322	601949	中国出版	16,300	103,179.00	0.08
323	600790	轻纺城	30,300	103,020.00	0.08
324	603108	润达医疗	10,300	102,382.00	0.08
325	300044	赛为智能	15,700	101,893.00	0.08
326	600300	维维股份	34,500	101,775.00	0.08
327	600997	开滦股份	18,700	101,728.00	0.08
328	600987	航民股份	16,000	101,280.00	0.08

329	601101	昊华能源	20,700	101,223.00	0.08
330	600217	中再资环	19,700	100,864.00	0.08
331	002226	江南化工	18,400	100,832.00	0.08
332	600400	红豆股份	29,900	100,464.00	0.08
333	600658	电子城	19,000	100,320.00	0.08
334	002095	生意宝	4,500	100,260.00	0.08
335	600067	冠城大通	25,000	99,500.00	0.08
336	300194	福安药业	17,900	99,166.00	0.08
337	600055	万东医疗	9,600	99,072.00	0.08
338	601886	江河集团	13,600	98,736.00	0.07
339	600981	汇鸿集团	26,400	98,208.00	0.07
340	300367	东方网力	22,542	97,606.86	0.07
341	600548	深高速	8,420	96,830.00	0.07
342	600391	航发科技	7,000	96,670.00	0.07
343	300075	数字政通	8,400	95,676.00	0.07
344	600239	云南城投	33,100	95,659.00	0.07
345	300352	北信源	13,100	95,499.00	0.07
346	600894	广日股份	12,700	95,377.00	0.07
347	002695	煌上煌	5,800	95,120.00	0.07
348	300128	锦富技术	23,600	94,872.00	0.07
349	300726	宏达电子	3,600	94,752.00	0.07
350	300114	中航电测	8,300	94,454.00	0.07
351	600677	航天通信	10,800	94,176.00	0.07
352	600389	江山股份	4,553	94,110.51	0.07
353	300559	佳发教育	3,200	93,760.00	0.07
354	600076	康欣新材	21,300	93,507.00	0.07
355	300386	飞天诚信	5,900	93,161.00	0.07
356	002768	国恩股份	4,000	93,160.00	0.07
357	002240	威华股份	11,700	93,015.00	0.07
358	300373	扬杰科技	5,400	92,880.00	0.07
359	300759	康龙化成	1,800	92,772.00	0.07

360	600351	亚宝药业	15,900	92,697.00	0.07
361	600590	泰豪科技	15,900	92,538.00	0.07
362	600975	新五丰	11,500	92,460.00	0.07
363	603636	南威软件	8,100	91,773.00	0.07
364	601366	利群股份	16,300	91,769.00	0.07
365	300016	北陆药业	10,200	91,698.00	0.07
366	600963	岳阳林纸	20,600	91,258.00	0.07
367	300229	拓尔思	7,000	90,300.00	0.07
368	600626	申达股份	15,100	90,298.00	0.07
369	000676	智度股份	9,900	89,496.00	0.07
370	600096	云天化	16,800	89,040.00	0.07
371	600740	山西焦化	11,900	88,774.00	0.07
372	600106	重庆路桥	28,520	88,697.20	0.07
373	600090	同济堂	21,200	88,616.00	0.07
374	600855	航天长峰	7,200	88,488.00	0.07
375	603096	新经典	1,600	88,480.00	0.07
376	600636	三爱富	8,700	88,392.00	0.07
377	600825	新华传媒	15,400	88,242.00	0.07
378	000687	华讯方舟	13,000	87,230.00	0.07
379	600075	新疆天业	17,200	87,032.00	0.07
380	002308	威创股份	18,700	86,394.00	0.07
381	600710	苏美达	15,500	86,025.00	0.07
382	601952	苏垦农发	12,200	85,278.00	0.06
383	600136	当代明诚	6,900	84,870.00	0.06
384	600662	强生控股	18,600	84,444.00	0.06
385	600773	西藏城投	14,500	84,100.00	0.06
386	000950	重药控股	14,600	84,096.00	0.06
387	603337	杰克股份	4,000	83,840.00	0.06
388	600211	西藏药业	2,600	83,174.00	0.06
389	002928	华夏航空	6,800	82,824.00	0.06
390	002197	证通电子	10,300	82,400.00	0.06

391	600523	贵航股份	6,000	82,200.00	0.06
392	300378	鼎捷软件	5,500	82,060.00	0.06
393	300045	华力创通	8,800	82,016.00	0.06
394	603429	集友股份	2,300	81,190.00	0.06
395	600810	神马股份	10,200	80,478.00	0.06
396	600458	时代新材	11,413	80,461.65	0.06
397	600581	八一钢铁	22,600	80,456.00	0.06
398	600897	厦门空港	3,600	80,424.00	0.06
399	601107	四川成渝	19,100	80,411.00	0.06
400	600481	双良节能	24,200	80,344.00	0.06
401	603313	梦百合	3,800	80,218.00	0.06
402	300205	天喻信息	7,300	80,008.00	0.06
403	600508	上海能源	8,500	79,815.00	0.06
404	601515	东风股份	11,800	79,650.00	0.06
405	002322	理工环科	6,700	79,395.00	0.06
406	601126	四方股份	14,300	79,222.00	0.06
407	600676	交运股份	18,200	78,624.00	0.06
408	600322	天房发展	26,000	78,000.00	0.06
409	300684	中石科技	3,000	77,850.00	0.06
410	600715	文投控股	21,900	77,745.00	0.06
411	000935	四川双马	4,700	77,503.00	0.06
412	600995	文山电力	9,900	77,220.00	0.06
413	300510	金冠股份	11,000	77,000.00	0.06
414	603979	金诚信	8,616	76,940.88	0.06
415	300299	富春股份	15,700	76,773.00	0.06
416	000584	哈工智能	12,200	76,494.00	0.06
417	600229	城市传媒	10,700	75,970.00	0.06
418	600798	宁波海运	21,300	75,828.00	0.06
419	300215	电科院	11,400	75,582.00	0.06
420	600382	广东明珠	10,800	75,492.00	0.06
421	300638	广和通	1,200	75,240.00	0.06

422	002930	宏川智慧	5,000	75,100.00	0.06
423	300021	大禹节水	14,100	74,730.00	0.06
424	603012	创力集团	8,300	74,036.00	0.06
425	600603	广汇物流	14,888	73,695.60	0.06
426	600691	阳煤化工	35,000	73,500.00	0.06
427	002034	旺能环境	4,900	72,569.00	0.06
428	603458	勘设股份	3,800	72,542.00	0.06
429	002929	润建股份	2,600	72,020.00	0.05
430	603267	鸿远电子	1,400	71,834.00	0.05
431	002947	恒铭达	1,100	71,236.00	0.05
432	600933	爱柯迪	5,100	71,094.00	0.05
433	002913	奥士康	1,200	71,028.00	0.05
434	600290	ST华仪	25,000	71,000.00	0.05
435	600929	湖南盐业	10,800	70,848.00	0.05
436	603298	杭叉集团	5,500	70,840.00	0.05
437	603357	设计总院	6,720	70,694.40	0.05
438	603359	东珠生态	4,700	70,453.00	0.05
439	002636	金安国纪	8,200	70,274.00	0.05
440	601606	长城军工	6,400	70,016.00	0.05
441	600054	黄山旅游	7,600	69,692.00	0.05
442	603826	坤彩科技	4,200	68,838.00	0.05
443	002393	力生制药	2,500	68,325.00	0.05
444	603980	吉华集团	8,280	68,310.00	0.05
445	603063	禾望电气	7,300	68,182.00	0.05
446	600035	楚天高速	19,900	67,859.00	0.05
447	600758	红阳能源	15,600	67,704.00	0.05
448	600231	凌钢股份	24,500	67,620.00	0.05
449	300662	科锐国际	2,100	66,759.00	0.05
450	600684	珠江实业	17,600	66,704.00	0.05
451	603220	中贝通信	3,100	66,619.00	0.05
452	300368	汇金股份	8,100	66,582.00	0.05

453	603218	日月股份	3,200	66,464.00	0.05
454	300634	彩讯股份	3,677	66,406.62	0.05
455	603590	康辰药业	1,900	66,348.00	0.05
456	300148	天舟文化	16,800	66,192.00	0.05
457	601789	宁波建工	17,347	66,092.07	0.05
458	300213	佳讯飞鸿	10,100	66,054.00	0.05
459	300343	联创股份	22,937	65,829.19	0.05
460	600278	东方创业	6,200	65,782.00	0.05
461	603959	百利科技	6,500	65,650.00	0.05
462	002609	捷顺科技	7,600	65,284.00	0.05
463	300613	富瀚微	400	64,872.00	0.05
464	600467	好当家	26,100	64,728.00	0.05
465	603595	东尼电子	2,500	64,525.00	0.05
466	000058	深赛格	8,700	63,945.00	0.05
467	603666	亿嘉和	900	63,720.00	0.05
468	300237	美晨生态	24,400	63,684.00	0.05
469	603299	苏盐井神	9,200	63,572.00	0.05
470	002137	麦达数字	8,700	63,336.00	0.05
471	600227	圣济堂	25,057	62,893.07	0.05
472	002451	摩恩电气	6,500	62,855.00	0.05
473	002519	银河电子	16,000	62,720.00	0.05
474	600686	金龙汽车	8,900	62,478.00	0.05
475	300393	中来股份	4,300	62,307.00	0.05
476	600180	瑞茂通	8,900	62,122.00	0.05
477	603919	金徽酒	3,500	61,985.00	0.05
478	603612	索通发展	5,000	61,950.00	0.05
479	002016	世荣兆业	7,100	61,486.00	0.05
480	601015	陕西黑猫	19,200	61,440.00	0.05
481	600012	皖通高速	10,400	61,152.00	0.05
482	300288	朗玛信息	5,000	60,950.00	0.05
483	603587	地素时尚	2,400	60,912.00	0.05

484	603348	文灿股份	2,500	60,850.00	0.05
485	603801	志邦家居	2,600	60,554.00	0.05
486	603898	好莱客	3,700	60,458.00	0.05
487	603876	鼎胜新材	3,800	60,268.00	0.05
488	600650	锦江投资	5,800	58,870.00	0.04
489	300531	优博讯	3,600	58,536.00	0.04
490	601566	九牧王	5,100	58,344.00	0.04
491	000657	中钨高新	8,500	58,225.00	0.04
492	600876	洛阳玻璃	3,600	58,068.00	0.04
493	300771	智莱科技	900	57,357.00	0.04
494	000576	广东甘化	7,500	57,075.00	0.04
495	300624	万兴科技	900	56,790.00	0.04
496	603808	歌力思	3,800	56,506.00	0.04
497	603618	杭电股份	10,200	56,100.00	0.04
498	603713	密尔克卫	1,400	56,070.00	0.04
499	600638	新黄浦	7,900	55,458.00	0.04
500	603318	派思股份	4,800	55,344.00	0.04
501	603896	寿仙谷	1,800	54,396.00	0.04
502	300682	朗新科技	2,400	54,312.00	0.04
503	603728	鸣志电器	4,900	54,292.00	0.04
504	300533	冰川网络	1,200	53,796.00	0.04
505	603648	畅联股份	5,400	53,784.00	0.04
506	300520	科大国创	2,900	53,563.00	0.04
507	300357	我武生物	1,200	52,980.00	0.04
508	603579	荣泰健康	1,700	52,870.00	0.04
509	603105	芯能科技	7,300	52,195.00	0.04
510	603466	风语筑	3,500	51,870.00	0.04
511	300140	中环装备	4,800	51,456.00	0.04
512	000567	海德股份	5,700	51,357.00	0.04
513	603626	科森科技	4,900	50,911.00	0.04
514	300765	新诺威	1,400	49,980.00	0.04

515	000070	特发信息	4,500	48,825.00	0.04
516	600618	氯碱化工	6,600	48,774.00	0.04
517	002534	杭锅股份	6,300	48,636.00	0.04
518	600207	安彩高科	10,200	47,634.00	0.04
519	603773	沃格光电	1,400	47,166.00	0.04
520	603421	鼎信通讯	2,700	46,764.00	0.04
521	603327	福蓉科技	1,600	46,704.00	0.04
522	603777	来伊份	3,900	45,903.00	0.03
523	603839	安正时尚	3,500	45,850.00	0.03
524	000056	皇庭国际	11,000	45,540.00	0.03
525	600738	兰州民百	9,100	44,954.00	0.03
526	002662	京威股份	17,002	44,885.28	0.03
527	000011	深物业A	4,700	44,227.00	0.03
528	600283	钱江水利	4,200	43,932.00	0.03
529	603185	上机数控	1,740	43,848.00	0.03
530	300768	迪普科技	1,200	43,764.00	0.03
531	601619	嘉泽新能	11,400	43,548.00	0.03
532	603103	横店影视	2,300	43,263.00	0.03
533	002485	希努尔	6,200	42,718.00	0.03
534	002651	利君股份	8,600	41,710.00	0.03
535	603915	国茂股份	2,700	39,906.00	0.03
536	603533	掌阅科技	2,300	38,962.00	0.03
537	002782	可立克	3,600	38,196.00	0.03
538	000532	华金资本	3,100	36,859.00	0.03
539	603997	继峰股份	4,500	36,360.00	0.03
540	603557	起步股份	4,200	34,734.00	0.03
541	300674	宇信科技	1,300	34,255.00	0.03
542	002906	华阳集团	2,700	32,076.00	0.02
543	603619	中曼石油	2,300	32,062.00	0.02
544	603555	贵人鸟	5,400	31,860.00	0.02
545	603098	森特股份	2,800	31,024.00	0.02

546	603711	香飘飘	1,200	30,720.00	0.02
547	300428	四通新材	2,100	29,526.00	0.02
548	603733	仙鹤股份	2,000	28,520.00	0.02
549	603900	莱绅通灵	3,000	28,350.00	0.02
550	603058	永吉股份	3,700	27,454.00	0.02
551	603680	今创集团	2,300	23,943.00	0.02
552	603956	威派格	1,400	23,226.00	0.02
553	002951	金时科技	1,307	22,611.10	0.02
554	603676	卫信康	1,900	20,159.00	0.02
555	603989	艾华集团	800	17,456.00	0.01
556	300618	寒锐钴业	200	16,478.00	0.01
557	300568	星源材质	100	3,021.00	0.00
558	300209	天泽信息	100	1,427.00	0.00
559	002023	海特高新	100	1,205.00	0.00
560	002041	登海种业	100	963.00	0.00
561	000889	中嘉博创	100	935.00	0.00
562	002428	云南锗业	100	851.00	0.00
563	002436	兴森科技	100	814.00	0.00
564	002590	万安科技	50	345.00	0.00
565	000793	华闻集团	100	337.00	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	603916	苏博特	51,200	864,256.00	0.66
2	603986	兆易创新	4,100	840,049.00	0.64
3	600887	伊利股份	27,100	838,474.00	0.64

4	600183	生益科技	39,900	834,708.00	0.63
5	601965	中国汽研	100,800	834,624.00	0.63
6	603901	永创智能	78,250	832,580.00	0.63
7	603661	恒林股份	18,800	826,072.00	0.63
8	603729	龙韵股份	51,900	825,210.00	0.63
9	603003	龙宇燃油	101,200	821,744.00	0.62
10	603633	徕木股份	79,508	816,547.16	0.62
11	603358	华达科技	55,117	815,180.43	0.62
12	600446	金证股份	38,000	782,040.00	0.59
13	603168	莎普爱思	87,947	763,379.96	0.58
14	600745	闻泰科技	8,200	758,500.00	0.58
15	603277	银都股份	67,700	727,098.00	0.55
16	603799	华友钴业	15,600	614,484.00	0.47
17	603667	五洲新春	58,000	553,900.00	0.42
18	600406	国电南瑞	23,000	487,140.00	0.37
19	600188	兖州煤业	39,500	417,120.00	0.32
20	601319	中国人保	54,400	412,896.00	0.31
21	300709	精研科技	4,200	410,130.00	0.31
22	603227	雪峰科技	82,400	383,160.00	0.29
23	603129	春风动力	8,400	355,320.00	0.27
24	603167	渤海轮渡	31,600	340,964.00	0.26
25	603258	电魂网络	13,400	314,632.00	0.24
26	603501	韦尔股份	1,528	219,115.20	0.17
27	600031	三一重工	12,000	204,600.00	0.16
28	600837	海通证券	12,700	196,342.00	0.15
29	603665	康隆达	8,700	190,356.00	0.14
30	603016	新宏泰	10,200	172,380.00	0.13
31	603067	振华股份	20,500	124,230.00	0.09
32	600155	华创阳安	8,600	120,658.00	0.09
33	688078	龙软科技	2,248	94,303.60	0.07
34	603032	德新交运	3,500	77,700.00	0.06

35	600703	三安光电	4,200	77,112.00	0.06
36	688089	嘉必优	2,274	72,017.58	0.05
37	688081	兴图新科	1,892	53,373.32	0.04
38	601028	玉龙股份	10,400	53,144.00	0.04
39	300397	天和防务	1,800	53,118.00	0.04
40	603601	再升科技	2,900	22,185.00	0.02
41	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
42	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
43	601066	中信建投	500	15,200.00	0.01
44	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	-
45	603214	爱婴室	100	4,210.00	-
46	603332	苏州龙杰	100	2,704.00	-
47	603823	百合花	100	2,650.00	-
48	603060	国检集团	100	2,428.00	-
49	601900	南方传媒	100	926.00	-
50	600886	国投电力	100	918.00	-
51	603969	银龙股份	80	341.60	-

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	600745	闻泰科技	3,413,063.00	7.78
2	300271	华宇软件	3,214,726.00	7.33
3	603368	柳药股份	3,187,507.80	7.27
4	600602	云赛智联	3,168,412.00	7.23
5	603678	火炬电子	3,062,826.00	6.99
6	600323	瀚蓝环境	3,008,165.00	6.86
7	300502	新易盛	2,977,194.00	6.79
8	600330	天通股份	2,967,118.20	6.77

9	600491	龙元建设	2,918,625.00	6.66
10	600803	新奥股份	2,823,146.00	6.44
11	600031	三一重工	2,792,535.72	6.37
12	300367	东方网力	2,760,372.07	6.30
13	600261	阳光照明	2,724,145.00	6.21
14	002318	久立特材	2,698,598.00	6.15
15	603308	应流股份	2,680,133.69	6.11
16	603367	辰欣药业	2,649,431.00	6.04
17	600456	宝钛股份	2,639,611.00	6.02
18	002396	星网锐捷	2,610,339.00	5.95
19	002547	春兴精工	2,591,960.00	5.91
20	600728	佳都科技	2,587,008.26	5.90
21	600129	太极集团	2,565,030.00	5.85
22	600622	光大嘉宝	2,546,026.50	5.81
23	002035	华帝股份	2,521,288.38	5.75
24	603118	共进股份	2,516,685.20	5.74
25	600702	舍得酒业	2,515,089.00	5.74
26	000951	中国重汽	2,479,643.59	5.66
27	600529	山东药玻	2,475,618.73	5.65
28	603508	思维列控	2,457,957.00	5.61
29	603277	银都股份	2,427,021.00	5.54
30	600446	金证股份	2,418,560.00	5.52
31	600590	泰豪科技	2,409,102.00	5.49
32	603363	傲农生物	2,389,786.00	5.45
33	600571	信雅达	2,386,387.00	5.44
34	000697	炼石航空	2,350,018.00	5.36
35	603003	龙宇燃油	2,311,673.00	5.27
36	002138	顺络电子	2,269,704.00	5.18
37	000672	上峰水泥	2,265,226.00	5.17
38	603869	新智认知	2,230,046.00	5.09
39	600668	尖峰集团	2,229,585.00	5.08

40	002458	益生股份	2,220,468.00	5.06
41	300263	隆华科技	2,214,024.00	5.05
42	600136	当代明诚	2,207,610.00	5.03
43	600604	市北高新	2,198,343.00	5.01
44	601222	林洋能源	2,183,938.67	4.98
45	600496	精工钢构	2,154,369.00	4.91
46	601163	三角轮胎	2,145,255.00	4.89
47	600211	西藏药业	2,144,861.00	4.89
48	600675	中华企业	2,142,237.00	4.89
49	600343	航天动力	2,097,486.00	4.78
50	600477	杭萧钢构	2,097,368.71	4.78
51	600986	科达股份	2,093,181.00	4.77
52	603660	苏州科达	2,087,254.20	4.76
53	300292	吴通控股	2,079,560.00	4.74
54	000901	航天科技	2,076,651.00	4.74
55	600641	万业企业	2,070,730.00	4.72
56	000739	普洛药业	2,067,644.63	4.72
57	002182	云海金属	2,067,012.00	4.71
58	002648	卫星石化	2,066,489.00	4.71
59	300571	平治信息	2,061,597.00	4.70
60	000837	秦川机床	2,038,278.00	4.65
61	600308	华泰股份	2,025,194.00	4.62
62	600851	海欣股份	2,019,129.00	4.60
63	002675	东诚药业	2,018,408.00	4.60
64	002668	奥马电器	2,015,245.00	4.60
65	600873	梅花生物	2,014,969.00	4.60
66	002091	江苏国泰	2,011,787.85	4.59
67	600132	重庆啤酒	1,994,221.00	4.55
68	600720	祁连山	1,993,111.55	4.55
69	603358	华达科技	1,981,584.88	4.52
70	600172	黄河旋风	1,976,965.65	4.51

71	600230	沧州大化	1,974,318.00	4.50
72	300558	贝达药业	1,974,168.16	4.50
73	000828	东莞控股	1,965,196.00	4.48
74	002537	海联金汇	1,962,995.00	4.48
75	002081	金螳螂	1,955,656.00	4.46
76	300628	亿联网络	1,949,702.88	4.45
77	601929	吉视传媒	1,948,013.00	4.44
78	002283	天润曲轴	1,940,866.00	4.43
79	002097	山河智能	1,939,716.00	4.42
80	603777	来伊份	1,935,223.00	4.41
81	603839	安正时尚	1,924,321.20	4.39
82	002567	唐人神	1,915,397.00	4.37
83	600495	晋西车轴	1,908,444.00	4.35
84	603633	徕木股份	1,906,527.00	4.35
85	600850	华东电脑	1,903,537.00	4.34
86	002568	百润股份	1,900,750.00	4.33
87	603313	梦百合	1,895,700.00	4.32
88	002080	中材科技	1,892,560.00	4.32
89	600603	广汇物流	1,888,795.40	4.31
90	603456	九洲药业	1,888,111.40	4.31
91	002413	雷科防务	1,883,973.13	4.30
92	601588	北辰实业	1,872,919.00	4.27
93	600533	栖霞建设	1,871,778.00	4.27
94	600103	青山纸业	1,843,351.50	4.20
95	600337	美克家居	1,830,056.00	4.17
96	300226	上海钢联	1,827,470.00	4.17
97	600020	中原高速	1,824,764.34	4.16
98	300237	美晨生态	1,820,777.20	4.15
99	600133	东湖高新	1,820,256.00	4.15
100	600226	瀚叶股份	1,814,438.00	4.14
101	601858	中国科传	1,810,934.00	4.13

102	002055	得润电子	1,808,805.00	4.13
103	300699	光威复材	1,807,690.00	4.12
104	000933	神火股份	1,801,262.00	4.11
105	300014	亿纬锂能	1,798,756.00	4.10
106	000560	我爱我家	1,794,224.10	4.09
107	600184	光电股份	1,786,933.76	4.08
108	000429	粤高速 A	1,786,414.00	4.07
109	002258	利尔化学	1,780,605.00	4.06
110	603387	基蛋生物	1,774,948.00	4.05
111	600183	生益科技	1,770,555.00	4.04
112	601519	大智慧	1,767,266.00	4.03
113	000520	长航凤凰	1,766,172.00	4.03
114	300326	凯利泰	1,763,916.00	4.02
115	002531	天顺风能	1,762,865.00	4.02
116	600618	氯碱化工	1,761,531.00	4.02
117	002746	仙坛股份	1,761,203.60	4.02
118	600999	招商证券	1,756,645.00	4.01
119	300118	东方日升	1,754,428.79	4.00
120	000915	山大华特	1,750,454.00	3.99
121	600596	新安股份	1,747,419.93	3.99
122	600273	嘉化能源	1,742,226.00	3.97
123	603605	珀莱雅	1,734,800.00	3.96
124	601020	华钰矿业	1,725,489.00	3.94
125	002502	鼎龙文化	1,722,963.00	3.93
126	601668	中国建筑	1,718,478.00	3.92
127	600093	易见股份	1,717,451.00	3.92
128	600123	兰花科创	1,715,513.00	3.91
129	600990	四创电子	1,713,423.00	3.91
130	603803	瑞斯康达	1,713,119.00	3.91
131	601908	京运通	1,711,208.00	3.90
132	002262	恩华药业	1,705,717.00	3.89

133	300098	高新兴	1,700,080.00	3.88
134	600055	万东医疗	1,688,882.00	3.85
135	600059	古越龙山	1,688,549.00	3.85
136	000989	九芝堂	1,687,945.00	3.85
137	300377	赢时胜	1,683,873.00	3.84
138	600650	锦江投资	1,682,575.42	3.84
139	000683	远兴能源	1,675,670.00	3.82
140	002430	杭氧股份	1,669,740.00	3.81
141	002335	科华恒盛	1,661,011.00	3.79
142	300222	科大智能	1,656,267.00	3.78
143	300213	佳讯飞鸿	1,643,828.00	3.75
144	002100	天康生物	1,643,665.72	3.75
145	000935	四川双马	1,642,434.90	3.75
146	600619	海立股份	1,641,902.00	3.74
147	603167	渤海轮渡	1,637,059.00	3.73
148	601636	旗滨集团	1,635,286.00	3.73
149	000968	蓝焰控股	1,632,614.00	3.72
150	600963	岳阳林纸	1,630,313.00	3.72
151	300100	双林股份	1,626,813.00	3.71
152	600057	厦门象屿	1,622,246.32	3.70
153	300053	欧比特	1,613,989.00	3.68
154	600114	东睦股份	1,611,618.04	3.68
155	002313	日海智能	1,610,397.80	3.67
156	601116	三江购物	1,609,592.00	3.67
157	300038	数知科技	1,608,407.40	3.67
158	603609	禾丰牧业	1,606,424.00	3.66
159	000977	浪潮信息	1,600,373.24	3.65
160	000407	胜利股份	1,581,589.00	3.61
161	000710	贝瑞基因	1,580,489.26	3.60
162	000157	中联重科	1,576,760.00	3.60
163	600242	中昌数据	1,575,699.00	3.59

164	000591	太阳能	1,571,497.00	3.58
165	600577	精达股份	1,562,831.00	3.56
166	000900	现代投资	1,562,610.00	3.56
167	600667	太极实业	1,561,561.00	3.56
168	300232	洲明科技	1,558,513.80	3.55
169	300458	全志科技	1,557,151.00	3.55
170	002139	拓邦股份	1,556,850.00	3.55
171	002364	中恒电气	1,554,742.00	3.55
172	600449	宁夏建材	1,552,458.00	3.54
173	002468	申通快递	1,552,338.53	3.54
174	002126	银轮股份	1,546,196.00	3.53
175	300045	华力创通	1,546,029.93	3.53
176	300078	思创医惠	1,545,823.00	3.53
177	600887	伊利股份	1,545,145.00	3.52
178	300130	新国都	1,540,209.18	3.51
179	600711	盛屯矿业	1,530,265.00	3.49
180	600601	方正科技	1,526,856.00	3.48
181	300339	润和软件	1,523,142.00	3.47
182	002798	帝欧家居	1,517,701.55	3.46
183	600185	格力地产	1,514,938.66	3.46
184	002389	航天彩虹	1,514,593.00	3.45
185	002402	和而泰	1,509,646.00	3.44
186	000875	吉电股份	1,505,515.00	3.43
187	002157	正邦科技	1,505,511.00	3.43
188	300149	量子生物	1,502,599.00	3.43
189	600677	航天通信	1,502,079.00	3.43
190	002063	远光软件	1,500,390.00	3.42
191	600512	腾达建设	1,497,680.00	3.42
192	603603	博天环境	1,496,558.00	3.41
193	603429	集友股份	1,496,169.00	3.41
194	002022	科华生物	1,496,023.00	3.41

195	600480	凌云股份	1,493,457.00	3.41
196	002104	恒宝股份	1,491,321.00	3.40
197	002215	诺普信	1,491,237.00	3.40
198	600188	兖州煤业	1,490,462.00	3.40
199	000059	华锦股份	1,487,869.00	3.39
200	600210	紫江企业	1,487,867.00	3.39
201	600483	福能股份	1,485,809.00	3.39
202	601058	赛轮轮胎	1,483,857.00	3.38
203	300533	冰川网络	1,479,703.00	3.37
204	300355	蒙草生态	1,478,493.00	3.37
205	600812	华北制药	1,476,608.00	3.37
206	000155	川能动力	1,475,068.00	3.36
207	300368	汇金股份	1,472,133.62	3.36
208	002117	东港股份	1,466,787.00	3.35
209	600363	联创光电	1,465,186.00	3.34
210	000417	合肥百货	1,462,576.00	3.34
211	600200	江苏吴中	1,462,130.00	3.33
212	600106	重庆路桥	1,458,778.88	3.33
213	300205	天喻信息	1,458,556.00	3.33
214	000818	航锦科技	1,458,420.00	3.33
215	002597	金禾实业	1,452,777.00	3.31
216	601666	平煤股份	1,449,077.37	3.30
217	600105	永鼎股份	1,448,464.00	3.30
218	600797	浙大网新	1,445,247.00	3.30
219	000921	海信家电	1,444,313.99	3.29
220	603393	新天然气	1,443,752.34	3.29
221	603039	泛微网络	1,442,821.96	3.29
222	300369	绿盟科技	1,442,592.00	3.29
223	300145	中金环境	1,434,244.00	3.27
224	002643	万润股份	1,431,587.00	3.26
225	603108	润达医疗	1,430,402.46	3.26

226	300366	创意信息	1,429,906.00	3.26
227	603881	数据港	1,423,181.00	3.25
228	300212	易华录	1,422,151.60	3.24
229	300047	天源迪科	1,421,589.00	3.24
230	002020	京新药业	1,417,594.00	3.23
231	603901	永创智能	1,417,353.50	3.23
232	600997	开滦股份	1,417,148.00	3.23
233	601918	新集能源	1,417,008.00	3.23
234	300248	新开普	1,411,586.00	3.22
235	601139	深圳燃气	1,410,694.00	3.22
236	300300	汉鼎宇佑	1,405,229.00	3.20
237	300203	聚光科技	1,404,280.00	3.20
238	002036	联创电子	1,401,488.00	3.20
239	002421	达实智能	1,400,201.00	3.19
240	002168	惠程科技	1,398,701.00	3.19
241	300347	泰格医药	1,397,989.00	3.19
242	300016	北陆药业	1,395,768.00	3.18
243	002467	二六三	1,393,428.00	3.18
244	600587	新华医疗	1,393,044.24	3.18
245	300531	优博讯	1,388,308.00	3.17
246	000797	中国武夷	1,387,127.00	3.16
247	603180	金牌厨柜	1,377,417.00	3.14
248	603013	亚普股份	1,376,994.00	3.14
249	300102	乾照光电	1,376,646.00	3.14
250	603588	高能环境	1,374,422.00	3.13
251	600252	中恒集团	1,373,110.00	3.13
252	300379	东方通	1,371,135.05	3.13
253	600285	羚锐制药	1,366,216.00	3.12
254	600076	康欣新材	1,361,804.00	3.11
255	300451	创业慧康	1,359,726.00	3.10
256	601965	中国汽研	1,354,058.00	3.09

257	300737	科顺股份	1,346,832.00	3.07
258	002067	景兴纸业	1,343,694.00	3.06
259	600715	文投控股	1,342,327.00	3.06
260	603729	龙韵股份	1,338,662.00	3.05
261	300020	银江股份	1,333,664.00	3.04
262	603986	兆易创新	1,331,545.00	3.04
263	600886	国投电力	1,327,746.00	3.03
264	002073	软控股份	1,326,803.00	3.03
265	000731	四川美丰	1,325,937.99	3.02
266	000301	东方盛虹	1,324,519.00	3.02
267	601101	昊华能源	1,323,976.00	3.02
268	600562	国睿科技	1,320,299.20	3.01
269	300735	光弘科技	1,318,046.93	3.01
270	600707	彩虹股份	1,315,848.00	3.00
271	300482	万孚生物	1,314,580.00	3.00
272	002234	民和股份	1,310,534.00	2.99
273	600110	诺德股份	1,307,689.22	2.98
274	002698	博实股份	1,307,074.88	2.98
275	603218	日月股份	1,307,073.00	2.98
276	601375	中原证券	1,303,415.00	2.97
277	603026	石大胜华	1,303,253.00	2.97
278	002206	海利得	1,301,812.00	2.97
279	300365	恒华科技	1,301,162.00	2.97
280	603980	吉华集团	1,300,831.00	2.97
281	600708	光明地产	1,300,199.40	2.97
282	300349	金卡智能	1,300,095.00	2.97
283	002322	理工环科	1,297,018.00	2.96
284	002712	思美传媒	1,296,985.00	2.96
285	000902	新洋丰	1,293,883.00	2.95
286	600278	东方创业	1,293,108.76	2.95
287	300496	中科创达	1,292,810.35	2.95

288	002135	东南网架	1,291,512.00	2.95
289	601949	中国出版	1,288,412.00	2.94
290	002293	罗莱生活	1,286,429.00	2.93
291	002185	华天科技	1,283,958.23	2.93
292	600569	安阳钢铁	1,283,928.00	2.93
293	603005	晶方科技	1,283,518.00	2.93
294	300236	上海新阳	1,283,283.00	2.93
295	002130	沃尔核材	1,281,533.12	2.92
296	600681	百川能源	1,277,996.00	2.91
297	000910	大亚圣象	1,276,402.00	2.91
298	002029	七匹狼	1,269,503.00	2.90
299	600206	有研新材	1,269,284.48	2.89
300	603383	顶点软件	1,268,079.00	2.89
301	300233	金城医药	1,267,464.00	2.89
302	603916	苏博特	1,266,825.00	2.89
303	000049	德赛电池	1,265,698.00	2.89
304	603168	莎普爱思	1,260,118.51	2.87
305	603338	浙江鼎力	1,258,919.48	2.87
306	603661	恒林股份	1,257,642.00	2.87
307	603008	喜临门	1,255,226.00	2.86
308	002419	天虹股份	1,255,072.00	2.86
309	000035	中国天楹	1,254,888.00	2.86
310	300567	精测电子	1,253,959.50	2.86
311	600108	亚盛集团	1,253,038.00	2.86
312	600761	安徽合力	1,252,626.60	2.86
313	000733	振华科技	1,252,172.00	2.86
314	002327	富安娜	1,248,312.00	2.85
315	600684	珠江实业	1,248,284.00	2.85
316	600295	鄂尔多斯	1,246,028.00	2.84
317	300463	迈克生物	1,244,966.00	2.84
318	002657	中科金财	1,244,827.00	2.84

319	002007	华兰生物	1,239,753.00	2.83
320	300170	汉得信息	1,235,099.00	2.82
321	600481	双良节能	1,233,119.00	2.81
322	603599	广信股份	1,232,240.00	2.81
323	002203	海亮股份	1,231,464.29	2.81
324	603399	吉翔股份	1,228,831.00	2.80
325	601799	星宇股份	1,227,890.80	2.80
326	300012	华测检测	1,223,942.00	2.79
327	300137	先河环保	1,223,468.00	2.79
328	300194	福安药业	1,222,671.00	2.79
329	600063	皖维高新	1,221,233.00	2.79
330	601388	怡球资源	1,220,645.00	2.78
331	002481	双塔食品	1,220,038.00	2.78
332	300568	星源材质	1,218,994.00	2.78
333	300476	胜宏科技	1,214,536.07	2.77
334	000821	京山轻机	1,214,289.00	2.77
335	300036	超图软件	1,214,272.00	2.77
336	300223	北京君正	1,214,200.44	2.77
337	600197	伊力特	1,213,328.98	2.77
338	000584	哈工智能	1,213,150.00	2.77
339	000034	神州数码	1,211,905.00	2.76
340	300323	华灿光电	1,207,590.00	2.75
341	000851	高鸿股份	1,205,705.00	2.75
342	600693	东百集团	1,205,703.00	2.75
343	603050	科林电气	1,204,799.00	2.75
344	603636	南威软件	1,202,989.71	2.74
345	000815	美利云	1,202,122.00	2.74
346	600320	振华重工	1,200,231.00	2.74
347	002025	航天电器	1,197,279.00	2.73
348	002222	福晶科技	1,195,529.00	2.73
349	603727	博迈科	1,195,400.00	2.73

350	603823	百合花	1,194,926.00	2.73
351	000950	重药控股	1,192,291.00	2.72
352	603920	世运电路	1,191,661.00	2.72
353	000666	经纬纺机	1,191,123.00	2.72
354	600756	浪潮软件	1,187,668.00	2.71
355	300050	世纪鼎利	1,187,160.00	2.71
356	002145	中核钛白	1,180,795.00	2.69
357	600771	广誉远	1,180,312.00	2.69
358	002301	齐心集团	1,178,069.00	2.69
359	603969	银龙股份	1,177,220.68	2.68
360	000822	山东海化	1,173,500.00	2.68
361	603688	石英股份	1,172,733.00	2.67
362	600360	华微电子	1,166,710.00	2.66
363	002376	新北洋	1,164,961.00	2.66
364	600067	冠城大通	1,164,132.00	2.65
365	600502	安徽建工	1,160,473.40	2.65
366	002425	凯撒文化	1,159,079.00	2.64
367	600096	云天化	1,157,830.00	2.64
368	600742	一汽富维	1,155,338.00	2.63
369	603730	岱美股份	1,155,020.00	2.63
370	002171	楚江新材	1,150,932.00	2.62
371	002383	合众思壮	1,150,428.00	2.62
372	603345	安井食品	1,149,897.00	2.62
373	002822	中装建设	1,148,107.00	2.62
374	000498	山东路桥	1,146,872.00	2.62
375	000069	华侨城 A	1,145,100.00	2.61
376	000055	方大集团	1,140,823.00	2.60
377	000582	北部湾港	1,137,226.00	2.59
378	600838	上海九百	1,136,184.00	2.59
379	600361	华联综超	1,130,292.00	2.58
380	300529	健帆生物	1,129,892.60	2.58

381	300424	航新科技	1,126,902.00	2.57
382	002267	陕天然气	1,126,301.00	2.57
383	002705	新宝股份	1,125,945.00	2.57
384	300328	宜安科技	1,124,099.20	2.56
385	300299	富春股份	1,122,638.00	2.56
386	002096	南岭民爆	1,120,946.00	2.56
387	002235	安妮股份	1,118,048.00	2.55
388	300285	国瓷材料	1,116,374.00	2.55
389	600366	宁波韵升	1,112,799.00	2.54
390	002099	海翔药业	1,112,455.00	2.54
391	601566	九牧王	1,110,568.00	2.53
392	600676	交运股份	1,109,970.00	2.53
393	300188	美亚柏科	1,108,878.00	2.53
394	300398	飞凯材料	1,108,611.00	2.53
395	000811	冰轮环境	1,108,254.48	2.53
396	600305	恒顺醋业	1,108,034.00	2.53
397	601677	明泰铝业	1,107,845.84	2.53
398	601126	四方股份	1,107,760.00	2.53
399	600559	老白干酒	1,106,788.28	2.52
400	000601	韶能股份	1,100,469.00	2.51
401	002240	威华股份	1,095,935.00	2.50
402	300131	英唐智控	1,093,997.92	2.50
403	600959	江苏有线	1,090,716.00	2.49
404	002649	博彦科技	1,089,424.00	2.48
405	300360	炬华科技	1,087,413.00	2.48
406	300298	三诺生物	1,087,289.00	2.48
407	603595	东尼电子	1,084,962.00	2.47
408	300065	海兰信	1,084,444.50	2.47
409	000016	深康佳 A	1,082,654.00	2.47
410	002060	粤水电	1,080,782.00	2.46
411	000030	富奥股份	1,079,445.80	2.46

412	002298	中电兴发	1,079,180.00	2.46
413	002851	麦格米特	1,076,199.50	2.45
414	002303	美盈森	1,073,317.00	2.45
415	601319	中国人保	1,071,683.00	2.44
416	000550	江铃汽车	1,069,416.00	2.44
417	002246	北化股份	1,068,555.00	2.44
418	002165	红宝丽	1,065,930.00	2.43
419	002031	巨轮智能	1,063,495.00	2.43
420	002261	拓维信息	1,062,932.00	2.42
421	300311	任子行	1,061,926.00	2.42
422	600269	赣粤高速	1,061,673.00	2.42
423	600522	中天科技	1,059,491.00	2.42
424	002621	美吉姆	1,059,085.40	2.42
425	600661	昂立教育	1,055,424.00	2.41
426	002033	丽江旅游	1,054,962.00	2.41
427	300322	硕贝德	1,050,525.00	2.40
428	600855	航天长峰	1,049,285.00	2.39
429	300054	鼎龙股份	1,045,325.31	2.38
430	300034	钢研高纳	1,044,321.78	2.38
431	000040	东旭蓝天	1,043,417.00	2.38
432	002156	通富微电	1,041,368.00	2.38
433	600420	现代制药	1,039,025.00	2.37
434	002550	千红制药	1,038,876.00	2.37
435	600936	广西广电	1,037,433.00	2.37
436	601900	南方传媒	1,033,656.00	2.36
437	300073	当升科技	1,032,831.00	2.36
438	002577	雷柏科技	1,031,721.20	2.35
439	600467	好当家	1,027,312.00	2.34
440	300068	南都电源	1,026,048.00	2.34
441	300288	朗玛信息	1,024,625.00	2.34
442	600531	豫光金铅	1,024,570.00	2.34

443	300219	鸿利智汇	1,022,553.00	2.33
444	002314	南山控股	1,021,780.00	2.33
445	300021	大禹节水	1,020,648.00	2.33
446	300177	中海达	1,020,107.00	2.33
447	300180	华峰超纤	1,019,602.00	2.33
448	600995	文山电力	1,018,400.00	2.32
449	300183	东软载波	1,018,093.00	2.32
450	300075	数字政通	1,016,369.00	2.32
451	002833	弘亚数控	1,016,148.00	2.32
452	600391	航发科技	1,016,102.00	2.32
453	603165	荣晟环保	1,015,892.00	2.32
454	601330	绿色动力	1,013,947.00	2.31
455	002511	中顺洁柔	1,012,726.00	2.31
456	603898	好莱客	1,012,180.00	2.31
457	002226	江南化工	1,011,177.00	2.31
458	300185	通裕重工	1,005,748.00	2.29
459	300294	博雅生物	1,000,012.00	2.28
460	000088	盐田港	999,083.00	2.28
461	300276	三丰智能	998,770.80	2.28
462	600825	新华传媒	995,242.00	2.27
463	603959	百利科技	992,985.60	2.26
464	002449	国星光电	992,968.65	2.26
465	002697	红旗连锁	989,658.00	2.26
466	000882	华联股份	989,420.00	2.26
467	600284	浦东建设	989,137.00	2.26
468	300759	康龙化成	985,334.36	2.25
469	603323	苏农银行	984,411.00	2.25
470	002292	奥飞娱乐	978,881.00	2.23
471	603612	索通发展	978,215.20	2.23
472	000800	一汽轿车	977,649.00	2.23
473	002400	省广集团	973,167.00	2.22

474	300552	万集科技	972,698.30	2.22
475	603169	兰石重装	972,517.00	2.22
476	300252	金信诺	972,218.00	2.22
477	000036	华联控股	970,872.00	2.21
478	002543	万和电气	969,143.00	2.21
479	002582	好想你	968,324.00	2.21
480	000546	金圆股份	966,844.00	2.21
481	002271	东方雨虹	966,020.37	2.20
482	300474	景嘉微	965,173.00	2.20
483	603214	爱婴室	963,894.00	2.20
484	601952	苏垦农发	962,566.40	2.20
485	603708	家家悦	961,936.20	2.19
486	300207	欣旺达	958,422.00	2.19
487	603126	中材节能	955,161.00	2.18
488	603711	香飘飘	954,351.00	2.18
489	002326	永太科技	953,887.00	2.18
490	000525	红太阳	952,617.00	2.17
491	600326	西藏天路	951,137.00	2.17
492	600227	圣济堂	950,602.00	2.17
493	600479	千金药业	950,125.00	2.17
494	600382	广东明珠	948,193.00	2.16
495	000883	湖北能源	948,028.00	2.16
496	002737	葵花药业	947,770.00	2.16
497	600686	金龙汽车	947,270.00	2.16
498	000708	中信特钢	946,999.00	2.16
499	603081	大丰实业	946,716.00	2.16
500	000676	智度股份	945,997.00	2.16
501	600790	轻纺城	944,694.00	2.15
502	300413	芒果超媒	944,524.30	2.15
503	603128	华贸物流	942,468.00	2.15
504	002756	永兴材料	940,731.00	2.15

505	300566	激智科技	940,001.00	2.14
506	002043	兔宝宝	939,454.00	2.14
507	300440	运达科技	936,536.90	2.14
508	603517	绝味食品	935,600.29	2.13
509	600422	昆药集团	933,030.00	2.13
510	600764	中国海防	932,791.00	2.13
511	000973	佛塑科技	932,710.00	2.13
512	300747	锐科激光	932,609.00	2.13
513	000917	电广传媒	932,143.00	2.13
514	002204	大连重工	931,754.00	2.13
515	300309	吉艾科技	930,561.00	2.12
516	002557	洽洽食品	926,467.72	2.11
517	002484	江海股份	926,461.00	2.11
518	603060	国检集团	925,004.00	2.11
519	601898	中煤能源	924,131.00	2.11
520	002123	梦网集团	922,353.00	2.10
521	603915	国茂股份	915,485.35	2.09
522	300031	宝通科技	913,553.00	2.08
523	600231	凌钢股份	911,819.00	2.08
524	300303	聚飞光电	904,989.00	2.06
525	000802	北京文化	904,838.00	2.06
526	002497	雅化集团	904,677.00	2.06
527	600966	博汇纸业	902,596.00	2.06
528	600550	保变电气	900,987.00	2.05
529	002626	金达威	900,506.00	2.05
530	300157	恒泰艾普	900,366.00	2.05
531	600621	华鑫股份	900,337.00	2.05
532	002510	天汽模	900,110.00	2.05
533	300083	劲胜智能	895,178.00	2.04
534	002047	宝鹰股份	893,173.00	2.04
535	300250	初灵信息	892,855.00	2.04

536	300007	汉威科技	891,715.00	2.03
537	002585	双星新材	891,091.00	2.03
538	600180	瑞茂通	890,582.50	2.03
539	000419	通程控股	888,528.00	2.03
540	300467	迅游科技	886,718.00	2.02
541	002436	兴森科技	886,524.00	2.02
542	600373	中文传媒	884,970.71	2.02
543	300140	中环装备	884,958.00	2.02
544	300352	北信源	884,894.00	2.02
545	300511	雪榕生物	883,850.00	2.02
546	600439	瑞贝卡	883,574.00	2.02
547	600229	城市传媒	882,866.00	2.01
548	002321	华英农业	881,560.00	2.01
549	002664	长鹰信质	880,685.00	2.01
550	002918	蒙娜丽莎	879,505.00	2.01
551	000889	中嘉博创	879,396.00	2.01
552	002867	周大生	878,475.00	2.00
553	300523	辰安科技	877,854.00	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	600602	云赛智联	3,168,982.00	7.23
2	600330	天通股份	3,044,873.00	6.94
3	600745	闻泰科技	3,023,113.00	6.89
4	603368	柳药股份	2,954,933.52	6.74
5	300502	新易盛	2,947,256.00	6.72
6	300271	华宇软件	2,928,752.00	6.68
7	600031	三一重工	2,748,525.00	6.27

8	600728	佳都科技	2,696,385.81	6.15
9	002318	久立特材	2,683,440.00	6.12
10	600456	宝钛股份	2,590,052.00	5.91
11	300367	东方网力	2,575,188.80	5.87
12	002547	春兴精工	2,515,702.00	5.74
13	002396	星网锐捷	2,489,026.00	5.68
14	002138	顺络电子	2,479,408.00	5.65
15	002035	华帝股份	2,457,019.00	5.60
16	600590	泰豪科技	2,456,723.00	5.60
17	600529	山东药玻	2,437,584.44	5.56
18	000951	中国重汽	2,425,526.88	5.53
19	600132	重庆啤酒	2,317,563.00	5.29
20	000672	上峰水泥	2,308,464.79	5.26
21	002537	海联金汇	2,257,663.00	5.15
22	002182	云海金属	2,244,841.57	5.12
23	000901	航天科技	2,241,900.00	5.11
24	603678	火炬电子	2,201,833.00	5.02
25	300263	隆华科技	2,189,604.00	4.99
26	600702	舍得酒业	2,166,122.00	4.94
27	600491	龙元建设	2,161,011.81	4.93
28	000739	普洛药业	2,154,892.00	4.91
29	000697	炼石航空	2,148,517.00	4.90
30	002668	奥马电器	2,147,609.00	4.90
31	603839	安正时尚	2,143,834.60	4.89
32	600211	西藏药业	2,118,979.00	4.83
33	600136	当代明诚	2,110,131.00	4.81
34	600323	瀚蓝环境	2,109,528.00	4.81
35	300014	亿纬锂能	2,107,202.00	4.81
36	600675	中华企业	2,101,866.13	4.79
37	002458	益生股份	2,075,898.80	4.73
38	000837	秦川机床	2,056,267.00	4.69

39	600641	万业企业	2,053,836.00	4.68
40	300628	亿联网络	2,049,514.72	4.67
41	603363	傲农生物	2,043,761.00	4.66
42	600477	杭萧钢构	2,034,984.80	4.64
43	000828	东莞控股	2,033,879.00	4.64
44	002283	天润曲轴	2,032,303.00	4.63
45	002091	江苏国泰	2,022,976.07	4.61
46	600261	阳光照明	1,977,945.41	4.51
47	603869	新智认知	1,962,641.55	4.48
48	600343	航天动力	1,959,636.00	4.47
49	002080	中材科技	1,954,182.34	4.46
50	002648	卫星石化	1,951,347.00	4.45
51	600803	新奥股份	1,949,407.00	4.45
52	600873	梅花生物	1,926,172.94	4.39
53	300292	吴通控股	1,924,572.00	4.39
54	603660	苏州科达	1,919,677.20	4.38
55	002568	百润股份	1,911,010.00	4.36
56	603308	应流股份	1,902,658.00	4.34
57	002675	东诚药业	1,880,681.00	4.29
58	600603	广汇物流	1,878,868.92	4.29
59	601588	北辰实业	1,868,431.00	4.26
60	603777	来伊份	1,864,124.80	4.25
61	600986	科达股份	1,860,144.00	4.24
62	002081	金螳螂	1,852,562.28	4.23
63	600999	招商证券	1,847,599.87	4.21
64	002746	仙坛股份	1,841,679.27	4.20
65	000977	浪潮信息	1,832,760.00	4.18
66	600273	嘉化能源	1,830,519.00	4.17
67	600851	海欣股份	1,828,355.00	4.17
68	600495	晋西车轴	1,823,772.00	4.16
69	600496	精工钢构	1,818,034.00	4.15

70	600337	美克家居	1,817,412.04	4.14
71	002262	恩华药业	1,815,704.70	4.14
72	603313	梦百合	1,813,808.83	4.14
73	601929	吉视传媒	1,811,003.00	4.13
74	603367	辰欣药业	1,800,754.00	4.11
75	002258	利尔化学	1,799,504.00	4.10
76	603277	银都股份	1,798,666.00	4.10
77	000560	我爱我家	1,794,712.40	4.09
78	600850	华东电脑	1,786,834.00	4.08
79	000520	长航凤凰	1,781,050.00	4.06
80	002430	杭氧股份	1,779,736.00	4.06
81	600618	氯碱化工	1,777,246.00	4.05
82	300098	高新兴	1,775,374.00	4.05
83	600020	中原高速	1,773,659.67	4.05
84	002531	天顺风能	1,767,367.00	4.03
85	002157	正邦科技	1,765,263.00	4.03
86	600103	青山纸业	1,763,638.30	4.02
87	002413	雷科防务	1,759,455.00	4.01
88	002097	山河智能	1,756,449.04	4.01
89	000429	粤高速 A	1,750,113.00	3.99
90	002567	唐人神	1,750,055.00	3.99
91	002055	得润电子	1,744,320.00	3.98
92	600059	古越龙山	1,741,398.00	3.97
93	300118	东方日升	1,732,796.00	3.95
94	002139	拓邦股份	1,732,533.50	3.95
95	600668	尖峰集团	1,726,983.00	3.94
96	002335	科华恒盛	1,722,709.00	3.93
97	300237	美晨生态	1,721,412.65	3.93
98	600446	金证股份	1,707,770.00	3.89
99	000968	蓝焰控股	1,704,597.00	3.89
100	600129	太极集团	1,701,042.00	3.88

101	600622	光大嘉宝	1,691,894.00	3.86
102	000591	太阳能	1,689,783.00	3.85
103	000989	九芝堂	1,689,393.00	3.85
104	600123	兰花科创	1,687,874.00	3.85
105	002063	远光软件	1,680,323.60	3.83
106	002126	银轮股份	1,675,366.00	3.82
107	000157	中联重科	1,671,061.00	3.81
108	000933	神火股份	1,666,835.44	3.80
109	000915	山大华特	1,664,218.00	3.80
110	300558	贝达药业	1,663,597.00	3.79
111	600812	华北制药	1,660,104.00	3.79
112	300053	欧比特	1,652,576.00	3.77
113	601668	中国建筑	1,649,510.84	3.76
114	600596	新安股份	1,641,153.92	3.74
115	000875	吉电股份	1,638,181.00	3.74
116	002364	中恒电气	1,635,866.00	3.73
117	600114	东睦股份	1,634,069.54	3.73
118	300226	上海钢联	1,633,441.16	3.73
119	002100	天康生物	1,627,754.00	3.71
120	000683	远兴能源	1,618,111.00	3.69
121	000059	华锦股份	1,616,533.00	3.69
122	600650	锦江投资	1,615,899.00	3.69
123	300339	润和软件	1,599,763.00	3.65
124	002313	日海智能	1,595,045.65	3.64
125	002020	京新药业	1,585,442.00	3.62
126	300145	中金环境	1,584,988.00	3.61
127	603003	龙宇燃油	1,581,578.00	3.61
128	002502	鼎龙文化	1,579,968.00	3.60
129	600577	精达股份	1,579,605.00	3.60
130	300213	佳讯飞鸿	1,575,658.00	3.59
131	600057	厦门象屿	1,574,031.00	3.59

132	300377	赢时胜	1,571,127.00	3.58
133	002643	万润股份	1,563,504.50	3.57
134	603118	共进股份	1,558,408.60	3.55
135	300347	泰格医药	1,555,885.68	3.55
136	002467	二六三	1,552,845.10	3.54
137	600480	凌云股份	1,551,856.00	3.54
138	600093	易见股份	1,550,507.00	3.54
139	000900	现代投资	1,548,106.00	3.53
140	000407	胜利股份	1,545,690.80	3.53
141	603508	思维列控	1,545,087.22	3.52
142	000935	四川双马	1,545,059.79	3.52
143	300045	华力创通	1,543,418.25	3.52
144	300223	北京君正	1,541,717.82	3.52
145	300130	新国都	1,540,492.00	3.51
146	600055	万东医疗	1,539,479.12	3.51
147	600667	太极实业	1,531,288.00	3.49
148	600449	宁夏建材	1,530,168.35	3.49
149	300100	双林股份	1,528,624.00	3.49
150	300699	光威复材	1,526,528.20	3.48
151	600604	市北高新	1,525,483.41	3.48
152	600963	岳阳林纸	1,525,067.00	3.48
153	300379	东方通	1,523,603.00	3.47
154	603609	禾丰牧业	1,522,000.00	3.47
155	300222	科大智能	1,521,859.56	3.47
156	300571	平治信息	1,516,584.00	3.46
157	600571	信雅达	1,508,156.00	3.44
158	300038	数知科技	1,505,774.80	3.43
159	002597	金禾实业	1,505,046.99	3.43
160	300326	凯利泰	1,504,883.31	3.43
161	002215	诺普信	1,500,484.00	3.42
162	601058	赛轮轮胎	1,497,737.00	3.42

163	300149	量子生物	1,495,544.00	3.41
164	000155	川能动力	1,488,959.00	3.40
165	300232	洲明科技	1,485,989.99	3.39
166	002798	帝欧家居	1,482,627.00	3.38
167	002104	恒宝股份	1,482,159.00	3.38
168	600512	腾达建设	1,477,688.00	3.37
169	603456	九洲药业	1,476,780.00	3.37
170	002022	科华生物	1,473,112.00	3.36
171	002402	和而泰	1,472,382.90	3.36
172	300533	冰川网络	1,469,387.00	3.35
173	002468	申通快递	1,461,709.00	3.33
174	300458	全志科技	1,461,419.00	3.33
175	300012	华测检测	1,457,287.00	3.32
176	600720	祁连山	1,457,255.00	3.32
177	603108	润达医疗	1,456,785.82	3.32
178	300205	天喻信息	1,456,020.79	3.32
179	000921	海信家电	1,453,424.00	3.31
180	600707	彩虹股份	1,448,122.00	3.30
181	000902	新洋丰	1,442,605.00	3.29
182	600230	沧州大化	1,441,284.00	3.29
183	002421	达实智能	1,435,031.00	3.27
184	600105	永鼎股份	1,434,042.00	3.27
185	002698	博实股份	1,432,716.50	3.27
186	002117	东港股份	1,429,696.50	3.26
187	300355	蒙草生态	1,427,124.00	3.25
188	600711	盛屯矿业	1,427,089.00	3.25
189	603393	新天然气	1,426,802.00	3.25
190	000301	东方盛虹	1,425,804.00	3.25
191	000797	中国武夷	1,425,432.30	3.25
192	300047	天源迪科	1,425,014.80	3.25
193	600715	文投控股	1,423,422.00	3.25

194	603881	数据港	1,423,374.00	3.25
195	600363	联创光电	1,421,569.00	3.24
196	300078	思创医惠	1,416,795.00	3.23
197	600677	航天通信	1,416,488.00	3.23
198	002073	软控股份	1,413,772.00	3.22
199	002168	惠程科技	1,411,272.00	3.22
200	300203	聚光科技	1,411,147.00	3.22
201	300300	汉鼎宇佑	1,410,881.14	3.22
202	300248	新开普	1,407,569.00	3.21
203	002419	天虹股份	1,406,330.00	3.21
204	000818	航锦科技	1,402,159.00	3.20
205	000417	合肥百货	1,401,527.00	3.20
206	000731	四川美丰	1,401,430.00	3.20
207	601139	深圳燃气	1,400,896.00	3.19
208	000710	贝瑞基因	1,399,747.00	3.19
209	300366	创意信息	1,394,453.00	3.18
210	601666	平煤股份	1,394,196.40	3.18
211	300236	上海新阳	1,388,109.00	3.17
212	600285	羚锐制药	1,384,209.00	3.16
213	300233	金城医药	1,379,877.00	3.15
214	600106	重庆路桥	1,376,840.20	3.14
215	002130	沃尔核材	1,375,433.00	3.14
216	002206	海利得	1,373,351.00	3.13
217	600886	国投电力	1,371,662.00	3.13
218	002185	华天科技	1,368,395.00	3.12
219	000910	大亚圣象	1,365,593.00	3.11
220	603429	集友股份	1,364,714.00	3.11
221	300368	汇金股份	1,363,981.00	3.11
222	300194	福安药业	1,363,640.00	3.11
223	002007	华兰生物	1,363,614.00	3.11
224	601799	星宇股份	1,362,065.00	3.11

225	600997	开滦股份	1,358,779.00	3.10
226	600185	格力地产	1,355,165.60	3.09
227	603167	渤海轮渡	1,352,449.00	3.08
228	300102	乾照光电	1,350,894.00	3.08
229	601163	三角轮胎	1,348,980.00	3.08
230	300531	优博讯	1,346,958.12	3.07
231	002067	景兴纸业	1,344,810.00	3.07
232	600483	福能股份	1,344,799.00	3.07
233	002135	东南网架	1,342,671.00	3.06
234	603338	浙江鼎力	1,341,749.18	3.06
235	600708	光明地产	1,341,176.15	3.06
236	600210	紫江企业	1,339,440.12	3.05
237	300285	国瓷材料	1,337,942.00	3.05
238	601949	中国出版	1,329,495.00	3.03
239	600172	黄河旋风	1,326,984.00	3.03
240	603039	泛微网络	1,324,758.96	3.02
241	300016	北陆药业	1,322,134.00	3.02
242	002327	富安娜	1,322,063.00	3.02
243	300369	绿盟科技	1,322,001.00	3.02
244	300365	恒华科技	1,319,782.50	3.01
245	600990	四创电子	1,318,204.00	3.01
246	603005	晶方科技	1,317,948.00	3.01
247	600601	方正科技	1,317,782.00	3.01
248	002293	罗莱生活	1,317,135.40	3.00
249	603218	日月股份	1,316,903.60	3.00
250	002322	理工环科	1,315,870.00	3.00
251	002025	航天电器	1,311,916.00	2.99
252	002712	思美传媒	1,308,713.80	2.98
253	000851	高鸿股份	1,305,365.00	2.98
254	601101	昊华能源	1,302,978.00	2.97
255	002389	航天彩虹	1,302,013.00	2.97

256	300349	金卡智能	1,297,881.00	2.96
257	600569	安阳钢铁	1,295,532.00	2.95
258	600797	浙大网新	1,292,586.00	2.95
259	000035	中国天楹	1,287,273.00	2.94
260	002099	海翔药业	1,287,143.00	2.94
261	600278	东方创业	1,281,763.02	2.92
262	600252	中恒集团	1,280,919.00	2.92
263	600110	诺德股份	1,280,545.00	2.92
264	600562	国睿科技	1,272,859.60	2.90
265	002222	福晶科技	1,270,712.00	2.90
266	600076	康欣新材	1,270,468.00	2.90
267	000666	经纬纺机	1,269,516.00	2.90
268	002145	中核钛白	1,266,055.00	2.89
269	002171	楚江新材	1,265,258.00	2.89
270	601918	新集能源	1,265,162.00	2.89
271	002203	海亮股份	1,261,863.94	2.88
272	300323	华灿光电	1,258,059.00	2.87
273	000733	振华科技	1,255,135.00	2.86
274	603599	广信股份	1,254,443.00	2.86
275	601222	林洋能源	1,253,733.00	2.86
276	002029	七匹狼	1,252,300.00	2.86
277	603980	吉华集团	1,249,049.00	2.85
278	600681	百川能源	1,245,642.60	2.84
279	603823	百合花	1,245,134.00	2.84
280	603727	博迈科	1,242,395.00	2.83
281	603358	华达科技	1,242,117.40	2.83
282	002481	双塔食品	1,238,321.00	2.82
283	300020	银江股份	1,237,581.00	2.82
284	300735	光弘科技	1,233,605.60	2.81
285	600206	有研新材	1,230,645.00	2.81
286	601908	京运通	1,228,126.00	2.80

287	603026	石大胜华	1,226,605.00	2.80
288	300328	宜安科技	1,224,321.00	2.79
289	300737	科顺股份	1,218,011.49	2.78
290	000055	方大集团	1,216,453.00	2.77
291	300050	世纪鼎利	1,213,045.00	2.77
292	600693	东百集团	1,211,786.00	2.76
293	002301	齐心集团	1,208,998.00	2.76
294	300567	精测电子	1,208,194.00	2.76
295	300212	易华录	1,204,639.00	2.75
296	002036	联创电子	1,202,943.00	2.74
297	000821	京山轻机	1,201,546.00	2.74
298	603969	银龙股份	1,200,943.20	2.74
299	002425	凯撒文化	1,200,694.00	2.74
300	300568	星源材质	1,199,920.00	2.74
301	601388	怡球资源	1,198,329.00	2.73
302	603636	南威软件	1,197,496.00	2.73
303	002376	新北洋	1,193,841.16	2.72
304	002822	中装建设	1,192,127.00	2.72
305	300219	鸿利智汇	1,186,199.00	2.71
306	603050	科林电气	1,185,611.60	2.70
307	300451	创业慧康	1,182,922.50	2.70
308	000584	哈工智能	1,182,378.00	2.70
309	000030	富奥股份	1,181,274.40	2.69
310	600481	双良节能	1,177,635.00	2.69
311	000069	华侨城 A	1,176,080.00	2.68
312	000815	美利云	1,173,589.00	2.68
313	300360	炬华科技	1,171,260.00	2.67
314	601636	旗滨集团	1,168,964.00	2.67
315	000822	山东海化	1,168,399.00	2.66
316	600838	上海九百	1,168,221.00	2.66
317	300529	健帆生物	1,167,299.00	2.66

318	600320	振华重工	1,167,212.51	2.66
319	600067	冠城大通	1,166,277.00	2.66
320	000049	德赛电池	1,165,633.64	2.66
321	601020	华钰矿业	1,164,260.00	2.66
322	603730	岱美股份	1,162,478.78	2.65
323	002246	北化股份	1,161,197.00	2.65
324	002096	南岭民爆	1,159,892.00	2.65
325	600684	珠江实业	1,156,494.00	2.64
326	002383	合众思壮	1,155,203.00	2.63
327	300065	海兰信	1,155,147.00	2.63
328	000950	重药控股	1,154,814.00	2.63
329	601126	四方股份	1,153,960.00	2.63
330	603399	吉翔股份	1,153,435.00	2.63
331	600063	皖维高新	1,149,950.00	2.62
332	000811	冰轮环境	1,148,359.52	2.62
333	600108	亚盛集团	1,148,260.00	2.62
334	300188	美亚柏科	1,147,248.20	2.62
335	002267	陕天然气	1,146,049.00	2.61
336	002550	千红制药	1,145,964.00	2.61
337	000016	深康佳 A	1,144,228.00	2.61
338	002298	中电兴发	1,144,010.00	2.61
339	000582	北部湾港	1,143,767.00	2.61
340	002060	粤水电	1,142,155.00	2.60
341	603688	石英股份	1,139,693.00	2.60
342	300311	任子行	1,137,249.06	2.59
343	601519	大智慧	1,136,326.00	2.59
344	002234	民和股份	1,136,040.00	2.59
345	000498	山东路桥	1,135,794.00	2.59
346	000883	湖北能源	1,135,680.35	2.59
347	002033	丽江旅游	1,135,213.00	2.59
348	300036	超图软件	1,133,532.00	2.59

349	600200	江苏吴中	1,130,816.76	2.58
350	002705	新宝股份	1,129,743.00	2.58
351	600308	华泰股份	1,129,211.00	2.58
352	600096	云天化	1,129,146.00	2.58
353	601375	中原证券	1,129,039.00	2.57
354	300424	航新科技	1,125,823.00	2.57
355	300183	东软载波	1,123,154.00	2.56
356	600502	安徽建工	1,122,303.40	2.56
357	300463	迈克生物	1,121,954.00	2.56
358	603588	高能环境	1,121,194.00	2.56
359	002031	巨轮智能	1,117,924.00	2.55
360	600676	交运股份	1,116,619.00	2.55
361	600360	华微电子	1,115,914.00	2.55
362	603633	徕木股份	1,115,830.36	2.54
363	601900	南方传媒	1,115,428.00	2.54
364	300482	万孚生物	1,114,420.00	2.54
365	002649	博彦科技	1,113,528.00	2.54
366	002235	安妮股份	1,113,003.00	2.54
367	300496	中科创达	1,112,463.00	2.54
368	300207	欣旺达	1,111,087.00	2.53
369	600533	栖霞建设	1,110,450.00	2.53
370	300398	飞凯材料	1,108,831.60	2.53
371	000601	韶能股份	1,104,286.00	2.52
372	000550	江铃汽车	1,103,799.00	2.52
373	002240	威华股份	1,103,188.98	2.52
374	600188	兖州煤业	1,102,819.00	2.52
375	600197	伊力特	1,102,253.00	2.51
376	300131	英唐智控	1,101,697.00	2.51
377	600761	安徽合力	1,100,861.00	2.51
378	300303	聚飞光电	1,099,769.60	2.51
379	002156	通富微电	1,098,864.00	2.51

380	300185	通裕重工	1,098,561.00	2.51
381	601858	中国科传	1,098,359.00	2.50
382	002511	中顺洁柔	1,096,120.00	2.50
383	300476	胜宏科技	1,093,820.80	2.49
384	600661	昂立教育	1,093,399.98	2.49
385	300276	三丰智能	1,092,121.00	2.49
386	002261	拓维信息	1,091,700.00	2.49
387	603517	绝味食品	1,091,236.60	2.49
388	600361	华联综超	1,088,785.00	2.48
389	600959	江苏有线	1,087,900.80	2.48
390	002657	中科金财	1,086,556.00	2.48
391	300054	鼎龙股份	1,084,467.00	2.47
392	300137	先河环保	1,083,997.00	2.47
393	601677	明泰铝业	1,083,075.00	2.47
394	600845	宝信软件	1,082,237.00	2.47
395	002165	红宝丽	1,080,302.00	2.46
396	000546	金圆股份	1,078,048.00	2.46
397	002577	雷柏科技	1,076,625.08	2.46
398	300073	当升科技	1,072,264.00	2.45
399	000036	华联控股	1,069,759.00	2.44
400	600522	中天科技	1,068,851.00	2.44
401	300299	富春股份	1,063,130.60	2.42
402	300180	华峰超纤	1,056,483.00	2.41
403	300566	激智科技	1,055,717.51	2.41
404	600771	广誉远	1,055,032.60	2.41
405	603345	安井食品	1,048,757.00	2.39
406	600742	一汽富维	1,045,836.60	2.39
407	300298	三诺生物	1,041,896.00	2.38
408	002449	国星光电	1,041,793.00	2.38
409	601566	九牧王	1,040,883.00	2.37
410	000088	盐田港	1,038,379.00	2.37

411	600269	赣粤高速	1,035,811.00	2.36
412	600467	好当家	1,031,310.00	2.35
413	000650	仁和药业	1,030,955.00	2.35
414	002314	南山控股	1,028,487.00	2.35
415	000889	中嘉博创	1,027,036.00	2.34
416	002833	弘亚数控	1,025,494.00	2.34
417	002621	美吉姆	1,023,975.20	2.34
418	002756	永兴材料	1,021,788.00	2.33
419	603959	百利科技	1,019,434.72	2.32
420	600366	宁波韵升	1,018,686.00	2.32
421	603595	东尼电子	1,017,913.00	2.32
422	002303	美盈森	1,015,528.00	2.32
423	002484	江海股份	1,015,013.00	2.31
424	000034	神州数码	1,014,343.00	2.31
425	300021	大禹节水	1,013,314.00	2.31
426	300068	南都电源	1,012,514.14	2.31
427	600995	文山电力	1,009,202.00	2.30
428	603060	国检集团	1,009,036.40	2.30
429	603898	好莱客	1,007,956.00	2.30
430	000800	一汽轿车	1,007,883.00	2.30
431	300552	万集科技	1,004,782.00	2.29
432	603165	荣晟环保	1,003,696.00	2.29
433	300007	汉威科技	1,003,408.00	2.29
434	600420	现代制药	1,003,158.00	2.29
435	002582	好想你	1,002,145.00	2.29
436	300170	汉得信息	995,927.00	2.27
437	600855	航天长峰	995,830.00	2.27
438	002436	兴森科技	995,522.00	2.27
439	600479	千金药业	988,053.00	2.25
440	600756	浪潮软件	984,738.00	2.25
441	600382	广东明珠	984,065.10	2.24

442	002867	周大生	982,377.86	2.24
443	300288	朗玛信息	982,185.00	2.24
444	300252	金信诺	980,813.00	2.24
445	300083	劲胜智能	980,457.00	2.24
446	300075	数字政通	979,499.00	2.23
447	002717	岭南股份	977,248.60	2.23
448	000882	华联股份	976,611.00	2.23
449	002543	万和电气	976,088.65	2.23
450	002737	葵花药业	975,539.00	2.22
451	000040	东旭蓝天	974,414.00	2.22
452	002557	洽洽食品	973,071.00	2.22
453	300759	康龙化成	971,356.20	2.22
454	000676	智度股份	969,955.00	2.21
455	600305	恒顺醋业	969,650.00	2.21
456	603920	世运电路	969,621.00	2.21
457	600184	光电股份	968,978.00	2.21
458	300511	雪榕生物	968,196.00	2.21
459	002697	红旗连锁	966,658.00	2.20
460	600486	扬农化工	963,578.90	2.20
461	300157	恒泰艾普	963,221.00	2.20
462	002271	东方雨虹	963,165.68	2.20
463	000525	红太阳	962,179.00	2.19
464	002326	永太科技	962,095.00	2.19
465	300523	辰安科技	962,028.00	2.19
466	002043	兔宝宝	961,188.50	2.19
467	300284	苏交科	960,333.60	2.19
468	300440	运达科技	958,672.00	2.19
469	300034	钢研高纳	956,553.00	2.18
470	300177	中海达	955,742.00	2.18
471	002309	中利集团	954,162.48	2.18
472	002585	双星新材	954,092.00	2.18

473	600559	老白干酒	952,752.80	2.17
474	603008	喜临门	952,130.00	2.17
475	600686	金龙汽车	951,015.00	2.17
476	000967	盈峰环境	948,995.00	2.16
477	000789	万年青	947,662.64	2.16
478	603612	索通发展	947,107.80	2.16
479	603126	中材节能	943,499.00	2.15
480	002821	凯莱英	942,804.59	2.15
481	600439	瑞贝卡	941,939.00	2.15
482	002610	爱康科技	941,538.00	2.15
483	300039	上海凯宝	938,178.00	2.14
484	000043	中航善达	937,968.00	2.14
485	002204	大连重工	937,797.00	2.14
486	300309	吉艾科技	937,750.00	2.14
487	600391	航发科技	936,958.00	2.14
488	002429	兆驰股份	936,839.00	2.14
489	300413	芒果超媒	936,349.30	2.14
490	300322	硕贝德	936,309.00	2.14
491	603711	香飘飘	935,437.02	2.13
492	603566	普莱柯	933,876.00	2.13
493	600825	新华传媒	933,330.00	2.13
494	000751	锌业股份	931,623.00	2.12
495	603214	爱婴室	931,046.00	2.12
496	600531	豫光金铅	929,038.00	2.12
497	002042	华孚时尚	928,326.00	2.12
498	002664	长鹰信质	927,483.00	2.12
499	600227	圣济堂	927,194.07	2.11
500	601898	中煤能源	927,092.00	2.11
501	600133	东湖高新	926,461.00	2.11
502	002400	省广集团	924,738.00	2.11
503	002851	麦格米特	924,602.00	2.11

504	600422	昆药集团	923,262.00	2.11
505	000973	佛塑科技	922,864.00	2.10
506	603915	国茂股份	922,633.69	2.10
507	002538	司尔特	920,913.00	2.10
508	300250	初灵信息	919,898.00	2.10
509	000802	北京文化	918,364.00	2.09
510	002321	华英农业	915,458.00	2.09
511	002068	黑猫股份	914,127.00	2.08
512	000836	富通鑫茂	913,182.00	2.08
513	002510	天汽模	908,205.00	2.07
514	000603	盛达资源	907,534.00	2.07
515	600373	中文传媒	907,235.00	2.07
516	002626	金达威	906,576.00	2.07
517	002343	慈文传媒	906,418.00	2.07
518	600231	凌钢股份	904,698.60	2.06
519	600936	广西广电	904,454.00	2.06
520	300304	云意电气	904,243.00	2.06
521	300447	全信股份	903,933.80	2.06
522	300465	高伟达	903,685.00	2.06
523	002382	蓝帆医疗	903,266.00	2.06
524	300158	振东制药	902,922.00	2.06
525	601952	苏垦农发	902,805.00	2.06
526	600966	博汇纸业	901,129.00	2.06
527	000419	通程控股	899,450.00	2.05
528	603939	益丰药房	899,176.14	2.05
529	300031	宝通科技	891,887.00	2.03
530	300468	四方精创	890,614.00	2.03
531	300294	博雅生物	888,612.20	2.03
532	002918	蒙娜丽莎	888,144.00	2.03
533	603708	家家悦	884,681.68	2.02
534	300352	北信源	882,920.00	2.01

535	300388	国祯环保	882,536.00	2.01
536	603808	歌力思	882,190.80	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	1,370,742,836.47
卖出股票收入（成交）总额	1,312,510,399.90

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	560,336.00	0.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,871,375.00	2.18
	其中：政策性金融债	2,871,375.00	2.18
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	3,431,711.00	2.60

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	28,500	2,871,375.00	2.18
2	019611	19国债01	5,600	560,336.00	0.42

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
IC2002	IC2002	2	2,099,840.00	13,040.00	-
公允价值变动总额合计(元)				13,040.00	
股指期货投资本期收益(元)				-99,326.60	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				13,040.00	

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 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	305,841.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,226.73
5	应收申购款	617,220.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	984,289.30

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1000增强A	1,815	26,972.46	5,000,166.70	10.21%	43,954,849.36	89.79%
创金合信中证1000增强C	952	85,400.83	70,152,600.41	86.29%	11,148,987.86	13.71%
合计	2,708	48,100.67	75,152,767.11	57.70%	55,103,837.22	42.30%

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1000增强A	28,640.11	0.06%
	创金合信中证1000增强C	59,562.11	0.07%
	合计	88,202.22	0.07%

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	创金合信中证1000 增强A	0~10

基金	创金合信中证1000增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证1000增强A	0
	创金合信中证1000增强C	0
	合计	0

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	10,000,333.36	7.68%	10,000,333.36	7.68%	36月
基金管理人高级管理人员	32,838.01	0.03%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,033,171.37	7.71%	10,000,333.36	7.68%	36月

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
基金合同生效日(2016年12月22日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61

本报告期期初基金份额总额	27,019,851.67	31,914,948.65
本报告期基金总申购份额	89,886,029.33	217,227,537.91
减：本报告期基金总赎回份额	67,950,864.94	167,840,898.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	48,955,016.06	81,301,588.27

§ 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

- 1、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。
- 2、2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。
- 3、2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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3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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
金元证券	2	481,155,201.75	17.95%	105,490.14	10.25%	-
第一创业证券	2	2,199,497,419.58	82.05%	923,893.77	89.75%	-

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
金元证券	6,541,177.50	43.95%	13,900,000.00	55.82%	-	-	-	-
第一创业证券	8,343,484.89	56.05%	11,000,000.00	44.18%	-	-	-	-

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	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	公司官网、上海证券报	2019-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金增加华泰证券为代销机构的公告暨参加华泰证券费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报	2019-01-22
3	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2018年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报	2019-02-01
4	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第2号）	公司官网、上海证券报	2019-02-01
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与中投证券费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报	2019-03-28
6	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告	公司官网、上海证券报	2019-03-29
7	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	公司官网、上海证券报	2019-03-29
8	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、上海证券报	2019-04-04
9	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、上海证券报	2019-04-08

10	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年第一季度报告	公司官网、上海证券报	2019-04-22
11	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变更公告	公司官网、上海证券报	2019-07-06
12	创金合信中证1000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、上海证券报	2019-07-18
13	创金合信中证1000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、上海证券报	2019-08-05
14	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	公司官网、上海证券报	2019-08-05
15	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告	公司官网、上海证券报	2019-08-27
16	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告摘要	公司官网、上海证券报	2019-08-27
17	创金合信中证1000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、上海证券报	2019-10-23
18	创金合信中证1000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、上海证券报	2019-11-29
19	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2019年11月修订）	公司官网、上海证券报	2019-11-29

20	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2019年11月修订）	公司官网、上海证券报	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190304 - 20191219, 20191227 - 20191231	0.00	55,143,431.05	20,000,000.00	35,143,431.05	26.98%
	2	20191220 - 20191226	0.00	50,015,004.50	50,015,004.50	0.00	0.00%
	3	20191227 - 20191231	0.00	30,009,002.70	0.00	30,009,002.70	23.04%

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

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、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2019年年度报告。

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