
创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	67
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数	
基金主代码	005567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,425,239.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567	005568
报告期末下属分级基金的份额总额	19,459,584.21份	9,965,655.36份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

注：本基金自2019年1月19日起信息披露报纸由《中国证券报》、《上海证券报》变更为《中国证券报》。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
本期已实现收益	2,927,628.31	761,788.70
本期利润	1,909,830.71	-377,859.42
加权平均基金份额本期利润	0.0313	-0.0153
本期加权平均净值利润率	2.88%	-1.42%
本期基金份额净值增长率	7.39%	7.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	2,381,764.40	1,160,370.72
期末可供分配基金份额利润	0.1224	0.1164
期末基金资产净值	23,074,702.33	11,752,527.49
期末基金份额净值	1.1858	1.1793
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.58%	17.93%

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MSCI中国A股国际指数A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	9.60%	0.86%	8.95%	0.90%	0.65%	-0.04%
过去三个月	15.89%	0.88%	14.04%	0.97%	1.85%	-0.09%
过去六个月	7.39%	1.45%	4.14%	1.61%	3.25%	-0.16%
过去一年	18.50%	1.16%	10.21%	1.30%	8.29%	-0.14%
自基金合同生效起至今	18.58%	1.26%	-9.00%	1.40%	27.58%	-0.14%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.58%	0.86%	8.95%	0.90%	0.63%	-0.04%
过去三个月	15.82%	0.88%	14.04%	0.97%	1.78%	-0.09%
过去六个月	7.28%	1.45%	4.14%	1.61%	3.14%	-0.16%
过去一年	18.25%	1.16%	10.21%	1.30%	8.04%	-0.14%
自基金合同生效起至今	17.93%	1.26%	-9.00%	1.40%	26.93%	-0.14%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2020年6月30日，本公司共管理49只公募基金，其中混合型产品13只、指数型产品5只、债券型产品20只、股票型产品10只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约340.38亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	12年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指期货事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部副总监、基金经理。
孙雨	本基金基金经理	2020-	2020-	3	孙雨先生，中国国籍，中

		01-16	05-14	年	央财经大学硕士，2014年7月加入深圳证券交易所信息管理部（金融创新实验室）从事证券市场研究工作。2016年11月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品经理、基金经理助理、创金合信中证红利低波动指数发起式证券投资基金基金经理（2020年1月16日至2020年5月14日）、创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理（2020年1月16日至2020年5月14日）。
--	--	-------	-------	---	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及

分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数，业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的，考虑了境外投资者投资A股的相关限制（外资投资比例）和流动性因素（换手率等指标），入选的样本股主要为大中盘股票，其总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为60%左右。本基金的投资策略，正常情况下主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为1.1858元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.39%，同期业绩比较基准收益率为4.14%；截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为1.1793元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.28%，同期业绩比较基准收益率为4.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年上半年，全球经济呈缓慢复苏状态，主要央行将延续宽松的货币政策。中国国内经济遭受的短暂冲击已经过去，二季度数据显示复苏加快，IMF预测中国是唯一在2020年保持正增长的经济体。国内资本市场方面，各项改革措施加速推进，基本面长期向好，流动性较为充裕，海外增量资金仍然会持续流入。风险方面，全球疫情仍然是最大的不确定性来源，影响各国复产复工进程，同时随着美国大选周期临近，中国的外部政治环境可能面临一定恶化，需要关注短期事件带来的冲击。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

报告截止日:2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	655,820.15	4,777,818.20
结算备付金		125,758.25	1,097,539.98
存出保证金		58,066.40	177,463.73
交易性金融资产	6.4.7.2	34,107,274.20	104,361,102.37
其中：股票投资		32,885,444.20	102,517,377.37
基金投资		-	-
债券投资		1,221,830.00	1,843,725.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		186,852.62	-
应收利息	6.4.7.5	39,138.92	28,480.30
应收股利		-	-
应收申购款		138,673.65	62,677.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		35,311,584.19	110,505,081.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		317,278.56	892,002.73
应付管理人报酬		19,692.40	64,765.59
应付托管费		3,938.46	12,953.15
应付销售服务费		1,883.87	8,435.68
应付交易费用	6.4.7.7	45,353.33	128,370.08
应交税费		-	657.64
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,207.75	117,089.77
负债合计		484,354.37	1,224,274.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	29,425,239.57	99,039,630.47
未分配利润	6.4.7.10	5,401,990.25	10,241,176.60
所有者权益合计		34,827,229.82	109,280,807.07
负债和所有者权益总计		35,311,584.19	110,505,081.71

报告截止日2020年06月30日，基金份额总额29,425,239.57份，其中下属A类基金份额19,459,584.21份，C类基金份额9,965,655.36份。下属A类基金份额净值1.1858元，C类基金份额净值1.1793元。

6.2 利润表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		2,271,644.72	17,921,644.36
1. 利息收入		53,882.14	57,791.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,407.48	8,096.62
债券利息收入		35,474.66	49,694.78

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,276,853.17	1,443,737.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,163,362.41	588,740.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,232.19	-8,095.80
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-364,165.63	162,873.79
股利收益	6.4.7.15	482,888.58	700,218.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,157,445.72	16,399,143.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	98,355.13	20,972.13
减：二、费用		739,673.43	353,933.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	230,571.15	176,301.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,114.16	35,260.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	26,019.70	15,772.03
4. 交易费用	6.4.7.18	328,869.62	46,153.54
5. 利息支出		76.07	-
其中：卖出回购金融资产支出		76.07	-

6. 税金及附加		312.67	586.34
7. 其他费用	6.4.7.19	107,710.06	79,860.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,531,971.29	17,567,710.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,531,971.29	17,567,710.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	99,039,630.47	10,241,176.60	109,280,807.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,531,971.29	1,531,971.29
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）	-69,614,390.90	-6,371,157.64	-75,985,548.54
其中：1. 基金申购款	48,326,310.58	4,566,296.54	52,892,607.12
2. 基金赎回款	-117,940,701.48	-10,937,454.18	-128,878,155.66
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	29,425,239.57	5,401,990.25	34,827,229.82

(基金净值)			
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	82,306,992.26	-17,399,583.22	64,907,409.04
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	17,567,710.39	17,567,710.39
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)	-11,281,291.89	-171,272.08	-11,452,563.97
其中: 1. 基金申购款	11,997,933.57	-472,673.49	11,525,260.08
2. 基金赎回 款	-23,279,225.46	301,401.41	-22,977,824.05
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)	71,025,700.37	-3,144.91	71,022,555.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2442号《关于准予创金合信

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

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,900.09份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年

(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	655,820.15
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	655,820.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末2020年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	30,446,641.50	32,885,444.20	2,438,802.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,228,961.84	1,221,830.00	-7,131.84
	银行间市场	-	-	-

	合计	1, 228, 961. 84	1, 221, 830. 00	-7, 131. 84
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	31, 675, 603. 34	34, 107, 274. 20	2, 431, 670. 86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	96.04
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	54.99
应收债券利息	38,961.79
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	26.10
合计	39,138.92

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	45,353.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	45,353.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	110.67
预提费用	96,097.08
合计	96,207.75

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	83,112,702.25	83,112,702.25
本期申购	3,728,402.86	3,728,402.86
本期赎回(以“-”号填列)	-67,381,520.90	-67,381,520.90
本期末	19,459,584.21	19,459,584.21

6.4.7.9.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,926,928.22	15,926,928.22
本期申购	44,597,907.72	44,597,907.72
本期赎回(以“-”号填列)	-50,559,180.58	-50,559,180.58
本期末	9,965,655.36	9,965,655.36

注:申购含红利再投、转换入份(金)额,赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

单位:人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,067,019.03	4,592,553.92	8,659,572.95
本期利润	2,927,628.31	-1,017,797.60	1,909,830.71
本期基金份额交易产生的变动数	-4,612,882.94	-2,341,402.60	-6,954,285.54
其中:基金申购款	266,559.53	45,977.75	312,537.28
基金赎回款	-4,879,442.47	-2,387,380.35	-7,266,822.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,381,764.40	1,233,353.72	3,615,118.12

6.4.7.10.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

单位:人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	708,401.05	873,202.60	1,581,603.65
本期利润	761,788.70	-1,139,648.12	-377,859.42
本期基金份额交易产	-309,819.03	892,946.93	583,127.90

生的变动数			
其中：基金申购款	2,972,772.15	1,280,987.11	4,253,759.26
基金赎回款	-3,282,591.18	-388,040.18	-3,670,631.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,160,370.72	626,501.41	1,786,872.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	12,132.73
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	5,702.88
其他	571.87
合计	18,407.48

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	191,320,058.32
减：卖出股票成本总额	187,156,695.91
买卖股票差价收入	4,163,362.41

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,232.19
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	-5,232.19

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	929,349.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	906,611.19
减：应收利息总额	27,970.68
买卖债券差价收入	-5,232.19

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 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 2020年01月01日至2020年06月30日
期货投资	-364,165.63

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	482,888.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	482,888.58

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,137,585.72
——股票投资	-2,129,546.91
——债券投资	-8,038.81
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-19,860.00
——权证投资	-
——期货投资	-19,860.00
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	-2,157,445.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	98,301.30
转换费收入	53.83
合计	98,355.13

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期

	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	328,304.74
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	564.88
合计	328,869.62

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	29,673.11
信息披露费	59,344.47
汇划手续费	4,515.33
指数使用费	14,177.15
合计	107,710.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证	基金管理人的股东、基金代销机构

券”)	
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	30,078,187.11	99.05%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买	成交金额	占当期 债券买

		卖成交 总额的 比例		卖成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	6,007,791.97	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
第一创业 证券股份 有限公司	21,750.67	99.56%	15,598.10	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	230,571.15	176,301.31
其中：支付销售机构的客户维护费	71,047.84	83,096.54

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年06月30日	2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,114.16	35,260.30

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	3,199.13	3,199.13
第一创业证券	0.00	116.95	116.95
创金合信直销	0.00	6,042.09	6,042.09

合计	0.00	9,358.17	9,358.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	4,235.80	4,235.80
第一创业证券	0.00	69.13	69.13
创金合信直销	0.00	4,643.20	4,643.20
合计	0.00	8,948.13	8,948.13

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信MSCI中国A股国际指数A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至 2020年06月30日	2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.70%	9.00%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至 2020年06月30日	2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	50.18%	32.30%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年01月01日至2020年06月30日		2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

招商银行 股份有限 公司	655,820.15	12,132.73	1,741,877.57	5,600.35
--------------------	------------	-----------	--------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2020年6月30日，本基金持有20,090.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币715,236.26元，估值总额为677,434.80元，占基金资产净值比例为1.95%；持有4,900.00股中国交建A股普通股，成本总额为人民币41,237.02元，估值总额为35,966.00元，占基金资产净值比例为0.10%；持有3,700.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币26,461.57元，估值总额为25,604.00元，占基金资产净值比例为0.07%（2019年6月30日，本基金持有53,600.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币1,546,170.21元，估值总额为1,928,528.00元，占基金资产净值比例为2.72%；本基金持有9,000.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币48,577.00元，估值总额为57,060.00元，占基金资产净值比例为0.08%）。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688169	石头科技	2020-02-13	2020-08-21	新股锁定	271.12	365.14	681	184,632.72	248,660.34	-
688051	佳华科技	2020-03-	2020-09-	新股锁定	50.81	120.27	1,447	73,522.0	174,030.	-

		12	21					7	69	
688080	映翰通	2020-02-03	2020-08-12	新股锁定	27.63	86.78	1,697	46,888.11	147,265.66	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股流通受限	5.00	6.54	1,470	7,350.00	9,613.80	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	5.94	5.94	1,149	6,825.06	6,825.06	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新发流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	1,221,830.00	1,843,725.00
合计	1,221,830.00	1,843,725.00

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2020年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.71%。

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2020年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为34,531,185.58元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质

押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	655,820.15	-	-	-	655,820.15
结算备付金	125,758.25	-	-	-	125,758.25
存出保证金	58,066.40	-	-	-	58,066.40
交易性金融资产	1,221,830.00	-	-	32,885,444.20	34,107,274.20
应收证券清算款	-	-	-	186,852.62	186,852.62
应收利息	-	-	-	39,138.92	39,138.92
应收申	-	-	-	138,673.65	138,673.65

购款					
资产总计	2,061,474.80	-	-	33,250,109.39	35,311,584.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	317,278.56	317,278.56
应付管理人报酬	-	-	-	19,692.40	19,692.40
应付托管费	-	-	-	3,938.46	3,938.46
应付销售服务费	-	-	-	1,883.87	1,883.87
应付交易费用	-	-	-	45,353.33	45,353.33
其他负债	-	-	-	96,207.75	96,207.75
负债总计	-	-	-	484,354.37	484,354.37
利率敏感度缺口	2,061,474.80	-	-	32,765,755.02	34,827,229.82
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,777,818.20	-	-	-	4,777,818.20
结算备付金	1,097,539.98	-	-	-	1,097,539.98
存出保证金	177,463.73	-	-	-	177,463.73
交易性金融资产	1,843,725.00	-	-	102,517,377.37	104,361,102.37
应收利息	-	-	-	28,480.30	28,480.30
应收申购款	-	-	-	62,677.13	62,677.13
资产总计	7,896,546.91	-	-	102,608,534.80	110,505,081.71
负债					
应付证	-	-	-	-	-

券清算款					
应付赎回款	-	-	-	892,002.73	892,002.73
应付管理人报酬	-	-	-	64,765.59	64,765.59
应付托管费	-	-	-	12,953.15	12,953.15
应付销售服务费	-	-	-	8,435.68	8,435.68
应付交易费用	-	-	-	128,370.08	128,370.08
应交税费	-	-	-	657.64	657.64
其他负债	-	-	-	117,089.77	117,089.77
负债总计	-	-	-	1,224,274.64	1,224,274.64
利率敏感度缺口	7,896,546.91	-	-	101,384,260.16	109,280,807.07

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年6月30日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为3.51%(2019年12月31日:5.09%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日:同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	32,885,444.20	94.42	102,517,377.37	93.81
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	32,885,444.20	94.42	102,517,377.37	93.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他条件不变的情况下		
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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	比较基准上涨5%	1,658,939.78	5,161,608.04

比较基准下降5%	-1,658,939.78	-5,161,608.04
----------	---------------	---------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为32,279,433.57元，属于第二层次的余额为1,827,840.63元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次100,086,927.58元，第二层次4,274,174.79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2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,885,444.20	93.13
	其中：股票	32,885,444.20	93.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,221,830.00	3.46
	其中：债券	1,221,830.00	3.46
	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	781,578.40	2.21
8	其他各项资产	422,731.59	1.20
9	合计	35,311,584.19	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	553,820.00	1.59
B	采矿业	841,842.40	2.42
C	制造业	16,487,746.46	47.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	844,523.80	2.42
E	建筑业	660,644.00	1.90
F	批发和零售业	564,675.60	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	896,022.00	2.57

H	住宿和餐饮业	39,107.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,738,616.20	4.99
J	金融业	7,014,569.21	20.14
K	房地产业	1,114,193.64	3.20
L	租赁和商务服务业	494,485.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	269,484.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	26,796.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,175.00	0.14
Q	卫生和社会工作	331,288.56	0.95
R	文化、体育和娱乐业	283,959.56	0.82
S	综合	22,112.00	0.06
	合计	32,231,060.43	92.55

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	457,799.59	1.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,935.92	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,648.26	0.54
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	654,383.77	1.88

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,200	1,755,456.00	5.04
2	601318	中国平安	10,558	753,841.20	2.16
3	600036	招商银行	20,090	677,434.80	1.95
4	000858	五粮液	3,800	650,256.00	1.87
5	600276	恒瑞医药	5,180	478,114.00	1.37
6	600900	长江电力	21,500	407,210.00	1.17
7	300750	宁德时代	2,100	366,156.00	1.05
8	002475	立讯精密	6,780	348,153.00	1.00
9	603288	海天味业	2,620	325,928.00	0.94
10	601166	兴业银行	20,400	321,912.00	0.92
11	600000	浦发银行	28,788	304,577.04	0.87

12	002714	牧原股份	3,684	302,088.00	0.87
13	601888	中国中免	1,900	292,657.00	0.84
14	002415	海康威视	9,200	279,220.00	0.80
15	300760	迈瑞医疗	900	275,130.00	0.79
16	601398	工商银行	53,400	265,932.00	0.76
17	000002	万科 A	9,510	248,591.40	0.71
18	601288	农业银行	73,400	248,092.00	0.71
19	000001	平安银行	19,097	244,441.60	0.70
20	600030	中信证券	9,653	232,733.83	0.67
21	600585	海螺水泥	3,900	206,349.00	0.59
22	601328	交通银行	38,700	198,531.00	0.57
23	600016	民生银行	34,980	198,336.60	0.57
24	601668	中国建筑	41,400	197,478.00	0.57
25	603259	药明康德	1,960	189,336.00	0.54
26	600887	伊利股份	6,000	186,780.00	0.54
27	600048	保利地产	11,800	174,404.00	0.50
28	000661	长春高新	400	174,120.00	0.50
29	300015	爱尔眼科	3,968	172,409.60	0.50
30	601601	中国太保	6,200	168,950.00	0.49
31	000651	格力电器	2,941	166,372.37	0.48
32	300059	东方财富	7,997	161,539.40	0.46
33	002352	顺丰控股	2,900	158,630.00	0.46
34	000725	京东方 A	33,600	156,912.00	0.45
35	002142	宁波银行	5,946	156,201.42	0.45
36	600031	三一重工	8,300	155,708.00	0.45
37	600309	万华化学	3,100	154,969.00	0.44
38	000063	中兴通讯	3,800	152,494.00	0.44
39	601012	隆基股份	3,691	150,334.43	0.43
40	300122	智飞生物	1,500	150,225.00	0.43
41	002304	洋河股份	1,400	147,196.00	0.42
42	600588	用友网络	3,224	142,178.40	0.41

43	601818	光大银行	39,500	141,410.00	0.41
44	300498	温氏股份	6,320	137,776.00	0.40
45	601688	华泰证券	7,300	137,240.00	0.39
46	601766	中国中车	24,200	134,794.00	0.39
47	600104	上汽集团	7,700	130,823.00	0.38
48	002594	比亚迪	1,800	129,240.00	0.37
49	601211	国泰君安	7,400	127,724.00	0.37
50	000568	泸州老窖	1,400	127,568.00	0.37
51	000876	新希望	4,200	125,160.00	0.36
52	600999	招商证券	5,700	125,115.00	0.36
53	000895	双汇发展	2,700	124,443.00	0.36
54	600050	中国联通	25,700	124,388.00	0.36
55	601988	中国银行	35,000	121,800.00	0.35
56	601229	上海银行	14,102	117,046.60	0.34
57	600809	山西汾酒	800	116,000.00	0.33
58	000166	申万宏源	22,500	113,625.00	0.33
59	600745	闻泰科技	900	113,355.00	0.33
60	000538	云南白药	1,200	112,572.00	0.32
61	600690	海尔智家	6,305	111,598.50	0.32
62	300413	芒果超媒	1,700	110,840.00	0.32
63	001979	招商蛇口	6,501	106,876.44	0.31
64	600570	恒生电子	990	106,623.00	0.31
65	601066	中信建投	2,700	106,326.00	0.31
66	603986	兆易创新	443	104,508.13	0.30
67	601006	大秦铁路	14,800	104,192.00	0.30
68	601169	北京银行	21,100	103,390.00	0.30
69	601390	中国中铁	20,400	102,408.00	0.29
70	600436	片仔癀	600	102,150.00	0.29
71	600837	海通证券	8,100	101,898.00	0.29
72	603501	韦尔股份	500	100,975.00	0.29
73	600703	三安光电	4,000	100,000.00	0.29

74	600028	中国石化	25,500	99,705.00	0.29
75	002555	三七互娱	2,100	98,280.00	0.28
76	300601	康泰生物	600	97,296.00	0.28
77	601186	中国铁建	11,500	96,370.00	0.28
78	002241	歌尔股份	3,200	93,952.00	0.27
79	600406	国电南瑞	4,600	93,150.00	0.27
80	600547	山东黄金	2,520	92,282.40	0.26
81	601989	中国重工	22,900	91,600.00	0.26
82	601857	中国石油	21,700	90,923.00	0.26
83	002007	华兰生物	1,810	90,699.10	0.26
84	601138	工业富联	5,961	90,309.15	0.26
85	601933	永辉超市	9,600	90,048.00	0.26
86	603160	汇顶科技	400	89,160.00	0.26
87	601336	新华保险	2,000	88,560.00	0.25
88	300014	亿纬锂能	1,841	88,091.85	0.25
89	601899	紫金矿业	19,700	86,680.00	0.25
90	000938	紫光股份	2,000	85,960.00	0.25
91	600019	宝钢股份	18,700	85,272.00	0.24
92	000100	TCL科技	13,600	84,320.00	0.24
93	000776	广发证券	5,900	83,308.00	0.24
94	600346	恒力石化	5,920	82,880.00	0.24
95	002027	分众传媒	14,800	82,436.00	0.24
96	002230	科大讯飞	2,200	82,346.00	0.24
97	000338	潍柴动力	6,000	82,320.00	0.24
98	002024	苏宁易购	9,300	81,561.00	0.23
99	601088	中国神华	5,500	78,980.00	0.23
100	600015	华夏银行	12,900	78,948.00	0.23
101	300142	沃森生物	1,500	78,540.00	0.23
102	300433	蓝思科技	2,800	78,512.00	0.23
103	002050	三花智控	3,580	78,402.00	0.23
104	002410	广联达	1,100	76,670.00	0.22

105	601628	中国人寿	2,800	76,188.00	0.22
106	002311	海大集团	1,600	76,144.00	0.22
107	002624	完美世界	1,300	74,932.00	0.22
108	601009	南京银行	10,100	74,033.00	0.21
109	002916	深南电路	440	73,708.80	0.21
110	300347	泰格医药	717	73,047.96	0.21
111	600340	华夏幸福	3,000	68,580.00	0.20
112	002371	北方华创	400	68,364.00	0.20
113	600438	通威股份	3,900	67,782.00	0.19
114	600196	复星医药	2,000	67,700.00	0.19
115	600183	生益科技	2,300	67,321.00	0.19
116	300033	同花顺	500	66,540.00	0.19
117	600741	华域汽车	3,200	66,528.00	0.19
118	600919	江苏银行	11,600	65,772.00	0.19
119	300003	乐普医疗	1,800	65,736.00	0.19
120	603993	洛阳钼业	17,900	65,693.00	0.19
121	002493	荣盛石化	5,300	65,190.00	0.19
122	600009	上海机场	900	64,863.00	0.19
123	300124	汇川技术	1,700	64,583.00	0.19
124	002602	世纪华通	4,200	64,302.00	0.18
125	601788	光大证券	4,000	64,240.00	0.18
126	601100	恒立液压	800	64,160.00	0.18
127	002271	东方雨虹	1,564	63,545.32	0.18
128	600383	金地集团	4,600	63,020.00	0.18
129	002129	中环股份	2,800	62,888.00	0.18
130	300676	华大基因	400	62,364.00	0.18
131	002600	领益智造	5,800	61,654.00	0.18
132	601225	陕西煤业	8,500	61,285.00	0.18
133	601939	建设银行	9,700	61,207.00	0.18
134	002001	新和成	2,100	61,110.00	0.18
135	002841	视源股份	600	59,712.00	0.17

136	601901	方正证券	8,400	59,472.00	0.17
137	002460	赣锋锂业	1,100	58,927.00	0.17
138	002120	韵达股份	2,400	58,680.00	0.17
139	600958	东方证券	6,100	57,889.00	0.17
140	002236	大华股份	3,000	57,630.00	0.17
141	601877	正泰电器	2,152	56,705.20	0.16
142	300558	贝达药业	400	55,992.00	0.16
143	000977	浪潮信息	1,404	55,008.72	0.16
144	600886	国投电力	6,900	54,234.00	0.16
145	600893	航发动力	2,300	54,004.00	0.16
146	601985	中国核电	13,200	53,988.00	0.16
147	601669	中国电建	15,600	53,976.00	0.15
148	600926	杭州银行	6,040	53,876.80	0.15
149	600600	青岛啤酒	700	53,550.00	0.15
150	300136	信维通信	1,000	53,020.00	0.15
151	002127	南极电商	2,500	52,925.00	0.15
152	002812	恩捷股份	800	52,640.00	0.15
153	601816	京沪高铁	8,400	52,332.00	0.15
154	600606	绿地控股	8,400	51,912.00	0.15
155	002456	欧菲光	2,800	51,492.00	0.15
156	000069	华侨城 A	8,400	50,904.00	0.15
157	300529	健帆生物	730	50,735.00	0.15
158	300253	卫宁健康	2,210	50,697.40	0.15
159	601881	中国银河	4,400	50,468.00	0.14
160	000768	中航飞机	2,832	50,239.68	0.14
161	600584	长电科技	1,600	50,032.00	0.14
162	600763	通策医疗	300	50,031.00	0.14
163	300408	三环集团	1,800	49,860.00	0.14
164	603939	益丰药房	540	49,140.00	0.14
165	603899	晨光文具	900	49,140.00	0.14
166	600521	华海药业	1,442	48,927.06	0.14

167	002821	凯莱英	200	48,600.00	0.14
168	601990	南京证券	3,400	48,518.00	0.14
169	002414	高德红外	1,650	48,312.00	0.14
170	002384	东山精密	1,600	47,920.00	0.14
171	600845	宝信软件	810	47,854.80	0.14
172	603369	今世缘	1,200	47,748.00	0.14
173	002736	国信证券	4,200	47,460.00	0.14
174	000425	徐工机械	8,000	47,280.00	0.14
175	601377	兴业证券	6,900	47,265.00	0.14
176	002607	中公教育	1,700	47,175.00	0.14
177	603019	中科曙光	1,220	46,848.00	0.13
178	600872	中炬高新	800	46,824.00	0.13
179	300144	宋城演艺	2,680	46,364.00	0.13
180	601618	中国中冶	18,300	45,933.00	0.13
181	600061	国投资本	3,600	45,828.00	0.13
182	600029	南方航空	8,800	45,496.00	0.13
183	002157	正邦科技	2,600	45,448.00	0.13
184	600161	天坛生物	1,000	45,330.00	0.13
185	600332	白云山	1,400	45,262.00	0.13
186	002179	中航光电	1,100	45,111.00	0.13
187	000596	古井贡酒	300	45,072.00	0.13
188	601111	中国国航	6,800	44,948.00	0.13
189	603799	华友钴业	1,156	44,922.16	0.13
190	000656	金科股份	5,500	44,880.00	0.13
191	000963	华东医药	1,760	44,528.00	0.13
192	300308	中际旭创	700	44,100.00	0.13
193	000625	长安汽车	4,000	44,000.00	0.13
194	002049	紫光国微	600	43,650.00	0.13
195	002252	上海莱士	5,100	43,146.00	0.12
196	000157	中联重科	6,700	43,081.00	0.12
197	002463	沪电股份	1,700	42,466.00	0.12

198	603517	绝味食品	600	42,444.00	0.12
199	601727	上海电气	8,400	42,336.00	0.12
200	600352	浙江龙盛	3,300	42,207.00	0.12
201	601360	三六零	2,300	42,113.00	0.12
202	601162	天风证券	6,900	41,814.00	0.12
203	600660	福耀玻璃	2,000	41,740.00	0.12
204	600674	川投能源	4,500	41,715.00	0.12
205	300383	光环新网	1,600	41,712.00	0.12
206	300450	先导智能	900	41,589.00	0.12
207	603659	璞泰来	400	41,208.00	0.12
208	300454	深信服	200	41,192.00	0.12
209	600115	东方航空	9,600	40,512.00	0.12
210	600018	上港集团	9,600	40,320.00	0.12
211	601872	招商轮船	6,900	40,227.00	0.12
212	002385	大北农	4,400	40,084.00	0.12
213	601319	中国人保	6,200	39,928.00	0.11
214	000860	顺鑫农业	700	39,886.00	0.11
215	002065	东华软件	3,171	39,700.92	0.11
216	600536	中国软件	500	39,600.00	0.11
217	000066	中国长城	3,000	39,600.00	0.11
218	600298	安琪酵母	800	39,584.00	0.11
219	600760	中航沈飞	1,200	39,384.00	0.11
220	603707	健友股份	600	38,742.00	0.11
221	000783	长江证券	5,700	38,418.00	0.11
222	300595	欧普康视	550	38,137.00	0.11
223	600079	人福医药	1,400	38,108.00	0.11
224	600085	同仁堂	1,400	37,968.00	0.11
225	601108	财通证券	3,700	37,925.00	0.11
226	603338	浙江鼎力	500	37,885.00	0.11
227	002185	华天科技	2,800	37,884.00	0.11
228	002439	启明星辰	900	37,863.00	0.11

229	002299	圣农发展	1,300	37,700.00	0.11
230	600795	国电电力	20,300	37,555.00	0.11
231	300628	亿联网络	550	37,543.00	0.11
232	601600	中国铝业	13,600	37,536.00	0.11
233	002603	以岭药业	1,200	37,428.00	0.11
234	600867	通化东宝	2,140	37,300.20	0.11
235	600118	中国卫星	1,200	36,996.00	0.11
236	600705	中航资本	9,300	36,828.00	0.11
237	002690	美亚光电	700	36,820.00	0.11
238	601607	上海医药	2,000	36,760.00	0.11
239	600522	中天科技	3,200	36,640.00	0.11
240	600109	国金证券	3,200	36,512.00	0.10
241	600132	重庆啤酒	500	36,500.00	0.10
242	002146	荣盛发展	4,500	36,450.00	0.10
243	002223	鱼跃医疗	1,000	36,400.00	0.10
244	002180	纳思达	1,100	36,201.00	0.10
245	000786	北新建材	1,692	36,090.36	0.10
246	603605	珀莱雅	200	36,004.00	0.10
247	002373	千方科技	1,500	35,985.00	0.10
248	601800	中国交建	4,900	35,966.00	0.10
249	002202	金风科技	3,600	35,892.00	0.10
250	603882	金域医学	400	35,800.00	0.10
251	600143	金发科技	2,700	35,559.00	0.10
252	600111	北方稀土	3,800	35,416.00	0.10
253	600998	九州通	1,900	35,378.00	0.10
254	002032	苏泊尔	498	35,358.00	0.10
255	002153	石基信息	900	35,127.00	0.10
256	601919	中远海控	10,100	35,047.00	0.10
257	000703	恒逸石化	3,830	34,967.90	0.10
258	688396	华润微	800	34,752.00	0.10
259	600637	东方明珠	3,599	34,730.35	0.10

260	002773	康弘药业	700	34,720.00	0.10
261	000961	中南建设	3,900	34,710.00	0.10
262	600498	烽火通信	1,200	34,692.00	0.10
263	002405	四维图新	2,077	34,249.73	0.10
264	001914	招商积余	1,100	33,803.00	0.10
265	601555	东吴证券	4,140	33,782.40	0.10
266	002739	万达电影	2,200	33,594.00	0.10
267	600315	上海家化	700	33,530.00	0.10
268	300285	国瓷材料	1,000	33,510.00	0.10
269	600201	生物股份	1,200	33,408.00	0.10
270	603858	步长制药	1,155	33,321.75	0.10
271	002601	龙蟠佰利	1,800	33,300.00	0.10
272	600801	华新水泥	1,400	33,194.00	0.10
273	600390	五矿资本	4,700	33,182.00	0.10
274	600176	中国巨石	3,620	33,123.00	0.10
275	600023	浙能电力	9,400	32,994.00	0.09
276	000975	银泰黄金	2,100	32,928.00	0.09
277	600489	中金黄金	3,600	32,904.00	0.09
278	601018	宁波港	9,200	32,844.00	0.09
279	601231	环旭电子	1,500	32,760.00	0.09
280	000021	深科技	1,500	32,745.00	0.09
281	300251	光线传媒	3,000	32,730.00	0.09
282	002294	信立泰	1,100	32,626.00	0.09
283	600380	健康元	2,008	32,609.92	0.09
284	600895	张江高科	1,600	32,592.00	0.09
285	600011	华能国际	7,700	32,494.00	0.09
286	603658	安图生物	200	32,488.00	0.09
287	002152	广电运通	2,500	32,350.00	0.09
288	000050	深天马 A	2,100	32,256.00	0.09
289	300316	晶盛机电	1,300	32,162.00	0.09
290	600004	白云机场	2,100	32,004.00	0.09

291	002212	南洋股份	1,200	31,896.00	0.09
292	601021	春秋航空	900	31,716.00	0.09
293	601198	东兴证券	2,900	31,610.00	0.09
294	601658	邮储银行	6,900	31,533.00	0.09
295	600487	亨通光电	1,920	31,507.20	0.09
296	300146	汤臣倍健	1,600	31,504.00	0.09
297	002422	科伦药业	1,500	31,500.00	0.09
298	300699	光威复材	500	31,365.00	0.09
299	002558	巨人网络	1,800	31,320.00	0.09
300	600177	雅戈尔	5,251	31,295.96	0.09
301	002511	中顺洁柔	1,400	31,220.00	0.09
302	600779	水井坊	500	31,210.00	0.09
303	300482	万孚生物	300	31,200.00	0.09
304	300357	我武生物	500	31,125.00	0.09
305	601799	星宇股份	245	31,115.00	0.09
306	002508	老板电器	1,000	31,110.00	0.09
307	300496	中科创达	400	31,080.00	0.09
308	002465	海格通信	2,400	31,056.00	0.09
309	002353	杰瑞股份	1,000	31,000.00	0.09
310	600699	均胜电子	1,300	30,953.00	0.09
311	601998	中信银行	6,000	30,900.00	0.09
312	600271	航天信息	1,900	30,856.00	0.09
313	600642	申能股份	5,200	30,732.00	0.09
314	603712	七一二	800	30,704.00	0.09
315	601689	拓普集团	1,100	30,690.00	0.09
316	600598	北大荒	1,900	30,590.00	0.09
317	603589	口子窖	600	30,540.00	0.09
318	300661	圣邦股份	100	30,505.00	0.09
319	600739	辽宁成大	1,605	30,382.65	0.09
320	601838	成都银行	3,800	30,248.00	0.09
321	300207	欣旺达	1,600	30,240.00	0.09

322	002673	西部证券	3,700	30,192.00	0.09
323	600655	豫园股份	3,400	30,124.00	0.09
324	002156	通富微电	1,200	30,060.00	0.09
325	600426	华鲁恒升	1,700	30,056.00	0.09
326	002013	中航机电	3,800	30,020.00	0.09
327	603883	老百姓	300	30,012.00	0.09
328	300418	昆仑万维	1,200	29,952.00	0.09
329	002019	亿帆医药	1,300	29,861.00	0.09
330	002242	九阳股份	800	29,816.00	0.09
331	002926	华西证券	2,800	29,764.00	0.09
332	600150	中国船舶	1,700	29,648.00	0.09
333	600362	江西铜业	2,200	29,612.00	0.09
334	000728	国元证券	3,500	29,400.00	0.08
335	000999	华润三九	1,000	29,190.00	0.08
336	600068	葛洲坝	4,900	29,155.00	0.08
337	300088	长信科技	2,600	29,120.00	0.08
338	600170	上海建工	9,400	28,858.00	0.08
339	002507	涪陵榨菜	800	28,808.00	0.08
340	000513	丽珠集团	600	28,806.00	0.08
341	002075	沙钢股份	2,300	28,750.00	0.08
342	601878	浙商证券	2,900	28,739.00	0.08
343	601117	中国化学	5,200	28,496.00	0.08
344	600511	国药股份	700	28,469.00	0.08
345	600482	中国动力	1,800	28,260.00	0.08
346	600885	宏发股份	700	28,084.00	0.08
347	600066	宇通客车	2,300	28,060.00	0.08
348	300212	易华录	500	28,000.00	0.08
349	000739	普洛药业	1,200	27,948.00	0.08
350	600415	小商品城	5,700	27,759.00	0.08
351	002399	海普瑞	1,100	27,544.00	0.08
352	600369	西南证券	6,000	27,540.00	0.08

353	600297	广汇汽车	8,600	27,434.00	0.08
354	002131	利欧股份	7,100	27,406.00	0.08
355	000671	阳光城	4,300	27,262.00	0.08
356	601992	金隅集团	8,877	27,163.62	0.08
357	600208	新湖中宝	9,100	27,118.00	0.08
358	002939	长城证券	2,200	27,104.00	0.08
359	002557	洽洽食品	500	27,095.00	0.08
360	600089	特变电工	4,000	27,080.00	0.08
361	000627	天茂集团	5,192	27,050.32	0.08
362	000723	美锦能源	4,300	26,918.00	0.08
363	300070	碧水源	3,300	26,796.00	0.08
364	601179	中国西电	5,500	26,620.00	0.08
365	600875	东方电气	3,004	26,585.40	0.08
366	601966	玲珑轮胎	1,300	26,260.00	0.08
367	002468	申通快递	1,600	26,256.00	0.08
368	002958	青农商行	5,900	26,137.00	0.08
369	600667	太极实业	2,200	26,004.00	0.07
370	002500	山西证券	3,970	25,963.80	0.07
371	600909	华安证券	3,800	25,954.00	0.07
372	002078	太阳纸业	2,700	25,704.00	0.07
373	002030	达安基因	940	25,643.20	0.07
374	600535	天士力	1,580	25,627.60	0.07
375	002797	第一创业	3,700	25,604.00	0.07
376	600219	南山铝业	12,600	25,578.00	0.07
377	603866	桃李面包	500	25,445.00	0.07
378	002340	格林美	5,100	25,347.00	0.07
379	000750	国海证券	5,840	25,345.60	0.07
380	000423	东阿阿胶	700	25,067.00	0.07
381	600486	扬农化工	300	24,750.00	0.07
382	600038	中直股份	600	24,642.00	0.07
383	600027	华电国际	7,200	24,624.00	0.07

384	601233	桐昆股份	1,928	24,601.28	0.07
385	000932	华菱钢铁	6,500	24,505.00	0.07
386	000988	华工科技	1,000	24,430.00	0.07
387	002683	宏大爆破	700	24,430.00	0.07
388	600153	建发股份	3,000	24,300.00	0.07
389	601997	贵阳银行	3,380	24,200.80	0.07
390	002572	索菲亚	1,000	24,170.00	0.07
391	000540	中天金融	7,500	24,150.00	0.07
392	600026	中远海能	3,700	23,902.00	0.07
393	603000	人民网	1,200	23,796.00	0.07
394	600188	兖州煤业	2,700	23,652.00	0.07
395	603345	安井食品	200	23,600.00	0.07
396	002174	游族网络	900	23,472.00	0.07
397	600100	同方股份	3,200	23,328.00	0.07
398	000998	隆平高科	1,400	23,310.00	0.07
399	300024	机器人	1,700	23,239.00	0.07
400	000547	航天发展	1,700	23,239.00	0.07
401	603156	养元饮品	1,080	23,220.00	0.07
402	603833	欧派家居	200	23,180.00	0.07
403	002925	盈趣科技	400	23,176.00	0.07
404	601099	太平洋	7,300	23,141.00	0.07
405	000709	河钢股份	11,300	23,052.00	0.07
406	002281	光迅科技	700	23,002.00	0.07
407	600167	联美控股	1,600	22,944.00	0.07
408	600566	济川药业	900	22,914.00	0.07
409	601216	君正集团	9,000	22,860.00	0.07
410	002081	金螳螂	2,900	22,794.00	0.07
411	600155	华创阳安	1,900	22,781.00	0.07
412	600704	物产中大	5,395	22,712.95	0.07
413	600688	上海石化	6,500	22,620.00	0.06
414	300271	华宇软件	800	22,568.00	0.06

415	601128	常熟银行	3,000	22,530.00	0.06
416	000401	冀东水泥	1,400	22,456.00	0.06
417	601118	海南橡胶	4,600	22,356.00	0.06
418	600977	中国电影	1,700	22,321.00	0.06
419	000688	国城矿业	1,200	22,236.00	0.06
420	600754	锦江酒店	800	22,200.00	0.06
421	600673	东阳光	3,200	22,112.00	0.06
422	300017	网宿科技	2,600	22,074.00	0.06
423	000686	东北证券	2,600	21,970.00	0.06
424	600583	海油工程	4,800	21,840.00	0.06
425	000630	铜陵有色	11,200	21,616.00	0.06
426	600021	上海电力	2,900	21,460.00	0.06
427	002387	维信诺	1,500	21,420.00	0.06
428	600372	中航电子	1,600	21,312.00	0.06
429	000402	金融街	3,200	21,248.00	0.06
430	002396	星网锐捷	600	21,198.00	0.06
431	600528	中铁工业	2,400	21,168.00	0.06
432	600160	巨化股份	3,000	20,670.00	0.06
433	600733	北汽蓝谷	3,200	20,576.00	0.06
434	600460	士兰微	1,400	20,552.00	0.06
435	000729	燕京啤酒	3,000	20,550.00	0.06
436	601106	中国一重	7,300	20,513.00	0.06
437	000623	吉林敖东	1,300	20,449.00	0.06
438	601098	中南传媒	1,932	20,440.56	0.06
439	000825	太钢不锈	6,100	20,252.00	0.06
440	600959	江苏有线	5,360	20,153.60	0.06
441	002372	伟星新材	1,700	19,771.00	0.06
442	600256	广汇能源	7,300	19,710.00	0.06
443	000027	深圳能源	4,245	19,696.80	0.06
444	000415	渤海租赁	6,600	19,668.00	0.06
445	600497	驰宏锌锗	5,600	19,264.00	0.06

446	600820	隧道股份	3,400	19,210.00	0.06
447	002010	传化智联	3,500	19,040.00	0.05
448	600967	内蒙一机	1,800	18,702.00	0.05
449	600879	航天电子	2,900	18,676.00	0.05
450	600398	海澜之家	3,200	18,624.00	0.05
451	000581	威孚高科	900	18,612.00	0.05
452	000629	攀钢钒钛	9,200	18,492.00	0.05
453	600008	首创股份	6,100	18,361.00	0.05
454	600549	厦门钨业	1,540	18,233.60	0.05
455	000028	国药一致	400	18,004.00	0.05
456	002110	三钢闽光	2,700	17,982.00	0.05
457	601958	金钼股份	2,900	17,922.00	0.05
458	600737	中粮糖业	2,300	17,894.00	0.05
459	600675	中华企业	4,380	17,826.60	0.05
460	601699	潞安环能	3,200	17,824.00	0.05
461	300012	华测检测	900	17,784.00	0.05
462	000738	航发控制	1,300	17,745.00	0.05
463	600466	蓝光发展	3,280	17,679.20	0.05
464	600373	中文传媒	1,500	17,670.00	0.05
465	300026	红日药业	3,200	17,664.00	0.05
466	000997	新大陆	1,100	17,578.00	0.05
467	600446	金证股份	900	17,460.00	0.05
468	002195	二三四五	6,200	17,422.00	0.05
469	000046	泛海控股	4,600	17,342.00	0.05
470	002217	合力泰	3,300	17,325.00	0.05
471	600968	海油发展	7,300	17,009.00	0.05
472	600056	中国医药	1,200	16,980.00	0.05
473	002563	森马服饰	2,400	16,920.00	0.05
474	600258	首旅酒店	1,100	16,907.00	0.05
475	000089	深圳机场	2,200	16,852.00	0.05
476	600776	东方通信	1,100	16,599.00	0.05

477	000983	西山煤电	4,420	16,575.00	0.05
478	000883	湖北能源	4,700	16,544.00	0.05
479	600808	马钢股份	6,400	16,512.00	0.05
480	600376	首开股份	2,800	16,408.00	0.05
481	300296	利亚德	2,700	16,389.00	0.05
482	603885	吉祥航空	1,800	16,380.00	0.05
483	600718	东软集团	1,400	16,100.00	0.05
484	600572	康恩贝	2,900	15,950.00	0.05
485	002221	东华能源	1,800	15,822.00	0.05
486	000031	大悦城	3,100	15,779.00	0.05
487	601866	中远海发	8,500	15,640.00	0.04
488	601718	际华集团	4,700	15,604.00	0.04
489	600863	内蒙华电	6,200	15,252.00	0.04
490	601598	中国外运	4,700	15,181.00	0.04
491	600260	凯乐科技	1,100	14,872.00	0.04
492	000598	兴蓉环境	3,200	14,720.00	0.04
493	002506	协鑫集成	5,400	14,094.00	0.04
494	000898	鞍钢股份	5,700	13,965.00	0.04

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

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	688169	石头科技	681	248,660.34	0.71
2	688051	佳华科技	1,447	174,030.69	0.50
3	688080	映翰通	1,697	147,265.66	0.42
4	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.05
5	603087	甘李药业	172	17,251.60	0.05

6	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.03
7	600956	新天绿能	1,773	8,935.92	0.03
8	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.02
9	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.02
10	300840	酷特智能	1,149	6,825.06	0.02
11	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01
12	600037	歌华有线	100	1,520.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	9,613,277.00	8.80
2	000651	格力电器	4,601,754.89	4.21
3	600519	贵州茅台	3,159,192.00	2.89
4	600276	恒瑞医药	2,330,523.00	2.13
5	601166	兴业银行	2,133,124.00	1.95
6	600887	伊利股份	2,037,835.00	1.86
7	000333	美的集团	2,002,653.00	1.83
8	600030	中信证券	1,890,420.00	1.73
9	300760	迈瑞医疗	1,528,595.00	1.40
10	300750	宁德时代	1,458,726.00	1.33
11	600036	招商银行	1,295,591.00	1.19
12	600837	海通证券	1,287,940.00	1.18
13	600016	民生银行	1,185,843.23	1.09
14	601328	交通银行	1,183,581.00	1.08
15	000858	五粮液	1,174,455.00	1.07
16	600690	海尔智家	1,143,195.00	1.05
17	000002	万科A	1,122,596.40	1.03
18	300498	温氏股份	972,690.00	0.89

19	000661	长春高新	892,868.00	0.82
20	002475	立讯精密	880,142.00	0.81

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	10,797,847.71	9.88
2	600519	贵州茅台	7,124,643.00	6.52
3	000651	格力电器	4,747,187.00	4.34
4	600276	恒瑞医药	3,442,175.00	3.15
5	600036	招商银行	2,947,267.00	2.70
6	601166	兴业银行	2,777,047.00	2.54
7	000858	五粮液	2,575,520.00	2.36
8	000333	美的集团	2,573,907.00	2.36
9	600030	中信证券	2,399,955.65	2.20
10	600887	伊利股份	2,386,746.00	2.18
11	300750	宁德时代	2,025,177.00	1.85
12	003816	中国广核	1,825,446.92	1.67
13	000002	万科A	1,660,391.00	1.52
14	600016	民生银行	1,643,513.00	1.50
15	601328	交通银行	1,636,520.00	1.50
16	600900	长江电力	1,581,451.38	1.45
17	002475	立讯精密	1,565,905.00	1.43
18	300760	迈瑞医疗	1,564,985.00	1.43
19	600837	海通证券	1,418,419.00	1.30
20	600000	浦发银行	1,284,500.17	1.18

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本（成交）总额	119,654,309.65
卖出股票收入（成交）总额	191,320,058.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,221,830.00	3.51
	其中：政策性金融债	1,221,830.00	3.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,221,830.00	3.51

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018007	国开1801	12,200	1,221,830.00	3.51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-364,165.63
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-19,860.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,066.40
2	应收证券清算款	186,852.62
3	应收股利	-
4	应收利息	39,138.92
5	应收申购款	138,673.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,731.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688169	石头科技	248,660.34	0.71	新股锁定
2	688051	佳华科技	174,030.69	0.50	新股锁定
3	688080	映翰通	147,265.66	0.42	新股锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信MSCI中国A股国际指数A	1,178	16,519.17	5,000,450.09	25.70%	14,459,134.12	74.30%
创金合信MSCI中国A股国际指数C	459	21,711.67	5,000,450.00	50.18%	4,965,205.36	49.82%
合计	1,597	18,425.32	10,000,900.09	33.99%	19,424,339.48	66.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	83,833.09	0.43%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	8,396.65	0.08%
	合计	92,229.74	0.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	0~10
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	0
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	33.99%	10,000,900.09	33.99%	36月
基金管理人高级管理人员	15,134.07	0.05%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,016,034.16	34.04%	10,000,900.09	33.99%	36月

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信MSCI中国A股 国际指数A	创金合信MSCI中国A股 国际指数C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	55,960,583.31	12,417,879.67
本报告期期初基金份额总额	83,112,702.25	15,926,928.22
本报告期基金总申购份额	3,728,402.86	44,597,907.72
减：本报告期基金总赎回份额	67,381,520.90	50,559,180.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,459,584.21	9,965,655.36

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	213,087,941.46	69.20%	68,837.04	69.09%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	1,091,400.00	0.35%	463.23	0.46%	-
中泰证券	2	21,346,333.26	6.93%	6,901.04	6.93%	-
中信建投证券	2	72,413,975.89	23.52%	23,439.53	23.52%	-

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内退租广发证券的2个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	292,755.00	24.52%	300,000.00	100.00%	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	901,379.00	75.48%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信MSCI中国A股国际	公司官网、中国证券报	2020-01-18

	指数发起式证券投资基金(2020年1月)招募说明书(更新)		
2	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2020年1月)	公司官网、中国证券报	2020-01-18
3	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年第一季度报告	公司官网、中国证券报	2020-04-21
4	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2019年年度报告	公司官网、中国证券报	2020-04-30
5	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报	2020-05-14
6	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(2020年5月)招募说明书(更新)	公司官网、中国证券报	2020-05-15
7	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2020年5月)	公司官网、中国证券报	2020-05-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101 - 20200513	25,675,879.46	0.00	25,675,879.46	0.00	0.00%
	2	20200121 - 20200213, 20200427, 20200514 - 2	18,811,947.75	0.00	18,811,947.75	0.00	0.00%

		0200618					
3		20200603 - 20200630	10,000,900.09	0.00	0.00	10,000,900.09	33.99%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险</p> <p>(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；</p> <p>(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；</p> <p>(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；</p> <p>(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金 2020 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日