
创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
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	44
7.3 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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信价值红利混合	
基金主代码	002463	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年04月23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	371,000,949.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C
下属分级基金的交易代码	002463	005404
报告期末下属分级基金的份额总额	368,992,125.01份	2,008,824.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的具体比例。</p> <p>在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济指标，包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据、金融政策等，以判断经济波动对市场的影响；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；（3）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关</p>

	的各种政策出台对市场的影响等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.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115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《证券日报》变更为《中国证券报》。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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)	
	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C
本期已实现收益	24,513,451.48	169,063.62
本期利润	18,666,559.35	98,890.69
加权平均基金份额本期利润	0.0506	0.0347
本期加权平均净值利润率	5.34%	3.74%
本期基金份额净值增长率	5.29%	4.88%
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	2,663,545.10	-30,810.60
期末可供分配基金份额利润	0.0072	-0.0153
期末基金资产净值	371,655,670.11	1,978,014.15
期末基金份额净值	1.0072	0.9847
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	0.72%	-1.53%

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

创金合信价值红利混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.86%	0.73%	4.17%	0.53%	2.69%	0.20%
过去三个月	11.51%	0.74%	7.20%	0.54%	4.31%	0.20%
过去六个月	5.29%	0.77%	1.66%	0.90%	3.63%	-0.13%
过去一年	9.56%	0.55%	6.49%	0.72%	3.07%	-0.17%
自基金合同生效起至今	0.72%	0.84%	9.62%	0.81%	-8.90%	0.03%

创金合信价值红利混合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	6.80%	0.73%	4.17%	0.53%	2.63%	0.20%
过去三个月	11.30%	0.74%	7.20%	0.54%	4.10%	0.20%
过去六个月	4.88%	0.77%	1.66%	0.90%	3.22%	-0.13%
过去一年	8.75%	0.55%	6.49%	0.72%	2.26%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-1.53%	0.84%	9.62%	0.81%	-11.15%	0.03%

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		
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	2019-09-25	-	16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。
王林 峰	本基金基金经理	2019- 09-25	-	7 年	王林峰先生, 中山大学硕 士, 国籍: 中国。2012年7 月加入国元证券经纪 (香 港) 有限公司, 担任研究 部分析师。2015年5月加入 国元资产管理 (香港) 有 限公司, 历任资产管理部 研究员、投资经理。2018 年10月加入创金合信基金 管理有限公司, 曾任研究 员, 现任基金经理。
黄弢	本基金基金经理、权益投 资部总监	2020- 05-08	-	17 年	黄弢先生, 中国国籍, 清 华大学法学硕士, 2002年7 月加入长城基金管理有限 公司, 任市场部渠道主管, 2005年11月加入海富通基 金管理有限公司, 任市场 部南方区总经理、2008年2 月加入深圳市鼎诺投资管 理有限公司, 任公司执行 总裁, 2017年5月加入北京 和聚投资管理有限公司任

					首席策略师，2018年4月加入上海禾驹投资管理中心（有限合伙），任首席策略师，2020年2月加入创金合信基金管理有限公司，任权益投资部总监，兼任基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

一季度基于对疫情的谨慎观点，本产品维持较低仓位。二季度随着国内疫情的全面受控，各行业都进入复工复产的状态，在政策层面，中央确立“六保”的主基调，货币政

策通过降息降准不断引导实体融资利率下行，财政政策通过特别国债、地方债扩容以及各专项财政补贴的方式支持基建、消费和出口行业，从各项经济指标来观察，我们看到明确的环比改善迹象，因此二季度本产品采用更积极的投资策略，在仓位上予以大幅提升，组合构建方向上以行业景气度为优先观察指标，重点以电气设备、非银金融、医药生物、农林牧渔、通信为主，持仓品种以各行业有明显竞争优势的龙头个股为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信价值红利混合A基金份额净值为1.0072元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.29%，同期业绩比较基准收益率为1.66%；截至报告期末创金合信价值红利混合C基金份额净值为0.9847元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.88%，同期业绩比较基准收益率为1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济季度环比提升的确定性还是很强，上半年巨量的社融投放，为下半年的经济复苏打下坚实基础，其中投资增长的确定性最强，出口端无论是疫情物资还是生活必需品，中国供应链都是最佳供给，短期内难以替代，消费端随着经济的复苏，从必须消费品到可选消费品都大概率会继续回暖。海外疫情尽管仍然看不到明确的好转迹象，但对中国经济的影响可以适度淡化。

证券市场总体受益于国家在直接融资层面的战略性调整，如证监会前主席肖刚所言证券市场的重要性到达了前所未有的高度。下半年围绕着创业板注册制的正式实行，还会陆续有更多的改革措施出台，对于激发证券市场的活力会有积极的作用，银行发放牌照通过混业经营进入证券市场从长远来看也更有利于证券行业的做大做强。

从年初以来的情况看，北上资金持续流入A股市场，公募基金发行也频现爆款，资金搬家成为长期的重要趋势，因此对市场仍然持更乐观的态度。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度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: 创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

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	45,308,386.68	11,871,019.70
结算备付金		1,159,032.87	-

存出保证金		131,449.34	42,537.43
交易性金融资产	6.4.7.2	326,319,579.61	312,000,255.44
其中：股票投资		316,241,619.61	88,914,503.44
基金投资		-	-
债券投资		10,077,960.00	223,085,752.00
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	-	39,960,179.94
应收证券清算款		890,860.49	-
应收利息	6.4.7.5	357,270.01	3,218,708.29
应收股利		-	-
应收申购款		8,997.64	2,370.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		374,175,576.64	367,095,070.96
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		-	10,339,864.49
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		27,967.31	6,441.93
应付管理人报酬		238,358.03	239,762.51
应付托管费		74,486.89	74,925.77
应付销售服务费		1,408.21	2,140.69
应付交易费用	6.4.7.7	101,190.55	19,445.82
应交税费		0.34	4,547.65

应付利息		-	7,654.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,481.05	184,500.18
负债合计		541,892.38	10,879,283.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	371,000,949.76	372,426,406.18
未分配利润	6.4.7.10	2,632,734.50	-16,210,618.27
所有者权益合计		373,633,684.26	356,215,787.91
负债和所有者权益总计		374,175,576.64	367,095,070.96

报告截止日2020年06月30日，基金份额总额371,000,949.76份，其中下属A类基金份额368,992,125.01份，C类基金份额2,008,824.75份。下属A类基金份额净值1.0072元，C类基金份额净值0.9847元。

6.2 利润表

会计主体：创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

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		21,427,680.59	2,434,386.38
1. 利息收入		1,447,714.71	86,244.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	246,050.23	23,346.86
债券利息收入		1,146,412.32	62,897.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		55,252.16	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		25,894,436.27	2,219,508.21

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,529,325.17	2,230,483.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	447,067.10	-21,675.60
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,918,044.00	10,700.00
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,917,065.06	110,455.85
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	2,594.67	18,177.47
减：二、费用		2,662,230.55	421,882.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	1,403,622.01	110,178.84
2. 托管费	6.4.10.2. 2	438,631.78	18,363.15
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	10,583.55	32,043.34
4. 交易费用	6.4.7.18	686,596.36	231,474.96
5. 利息支出		5,600.30	-
其中：卖出回购金融资产 支出		5,600.30	-
6. 税金及附加		1,490.97	-
7. 其他费用	6.4.7.19	115,705.58	29,821.85
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		18,765,450.04	2,012,504.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		18,765,450.04	2,012,504.24

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金

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)	372,426,406.18	-16,210,618.27	356,215,787.91
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	18,765,450.04	18,765,450.04
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-1,425,456.42	77,902.73	-1,347,553.69
其中：1. 基金申购款	1,265,842.18	-76,324.98	1,189,517.20
2. 基金赎回 款	-2,691,298.60	154,227.71	-2,537,070.89
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)	371,000,949.76	2,632,734.50	373,633,684.26
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)	23,319,097.30	-2,213,785.15	21,105,312.15

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,012,504.24	2,012,504.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-13,037,496.52	-704,444.25	-13,741,940.77
其中:1.基金申购款	6,280,449.22	-98,483.32	6,181,965.90
2.基金赎回款	-19,317,945.74	-605,960.93	-19,923,906.67
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)	10,281,600.78	-905,725.16	9,375,875.62

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

创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金(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]1334号《关于准予创金合信尊益纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》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《创金合信价值红利灵活配置混合型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354,132,371.05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0033号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年4月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为354,154,585.00份基金份额,其中认购资

金利息折合 22,213.95 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《创金合信价值红利灵活配置混合型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《创金合信价值红利灵活配置混合型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（包括主板、创业板、中小板以及其他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、证券公司短期公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、金融衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 60% + 中债综合指数收益率 \times 40%。

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》、《创金合信价值红利灵活配置混合型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	45,308,386.68
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	45,308,386.68

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	316,190,739.80	316,241,619.61	50,879.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,960.00	4,960.00
	银行间市场	10,100,950.00	10,033,000.00
	合计	10,140,950.00	10,077,960.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	326,331,689.80	326,319,579.61	-12,110.19

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	4,309.73
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	521.60
应收债券利息	352,379.48
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	59.20
合计	357,270.01

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	101,190.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	101,190.55

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	0.47
预提费用	98,480.58
合计	98,481.05

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信价值红利混合A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信价值红利混合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	369,334,453.99	369,334,453.99
本期申购	423,520.12	423,520.12
本期赎回(以“-”号填列)	-765,849.10	-765,849.10
本期末	368,992,125.01	368,992,125.01

6.4.7.9.2 创金合信价值红利混合C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信价值红利混合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	3,091,952.19	3,091,952.19
本期申购	842,322.06	842,322.06
本期赎回(以“-”号填列)	-1,925,449.50	-1,925,449.50
本期末	2,008,824.75	2,008,824.75

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 创金合信价值红利混合A

单位：人民币元

项目 (创金合信价值红利混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,894,947.37	-7,126,870.42	-16,021,817.79
本期利润	24,513,451.48	-5,846,892.13	18,666,559.35
本期基金份额交易产生的变动数	-1,076.22	19,879.76	18,803.54
其中：基金申购款	-2,426.39	-19,428.02	-21,854.41
基金赎回款	1,350.17	39,307.78	40,657.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,617,427.89	-12,953,882.79	2,663,545.10

6.4.7.10.2 创金合信价值红利混合C

单位：人民币元

项目 (创金合信价值红利混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-129,564.71	-59,235.77	-188,800.48
本期利润	169,063.62	-70,172.93	98,890.69
本期基金份额交易产生的变动数	-507.81	59,607.00	59,099.19
其中：基金申购款	-28,527.16	-25,943.41	-54,470.57
基金赎回款	28,019.35	85,550.41	113,569.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,991.10	-69,801.70	-30,810.60

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	240,668.31
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	4,833.61
其他	548.31
合计	246,050.23

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	233,191,308.16
减：卖出股票成本总额	209,661,982.99
买卖股票差价收入	23,529,325.17

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	447,067.10
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	447,067.10

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	287,575,601.30

股及债券到期兑付)成交总额	
减: 卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	282,768,441.84
减: 应收利息总额	4,360,092.36
买卖债券差价收入	447,067.10

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

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

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	1,918,044.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,918,044.00

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	-5,917,065.06
——股票投资	-5,675,936.87
——债券投资	-241,128.19
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-5,917,065.06

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	2,579.61
转换费收入	15.06
合计	2,594.67

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	683,896.36
银行间市场交易费用	2,700.00
合计	686,596.36

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	29,808.24
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	3,125.00

账户维护费	22,500.00
查询服务费	600.00
合计	115,705.58

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。

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	352,506,145.62	52.80%	173,716,811.19	99.18%

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 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	60,797,373.13	98.86%

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	本期 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比例		额的比例
第一创业证券股份有限公司	254,780.94	71.57%	-	-
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	125,232.43	99.64%	35,737.65	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,403,622.01	110,178.84
其中:支付销售机构的客户维护费	5,102.97	33,229.28

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。

自2019年11月04日起，本基金管理费由1.50%调整为0.80%，详情可见于2019年11月02日披露的《关于创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率并修改基金合同的公告》。

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	438,631.78	18,363.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

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		
	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C	合计
招商银行	0.00	1,017.95	1,017.95
合计	0.00	1,017.95	1,017.95
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		
	创金合信价值红利混合A	创金合信价值红利混合C	合计

第一创业 证券	0.00	1.48	1.48
招商银行	0.00	194.08	194.08
合计	0.00	195.56	195.56

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。C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.80%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 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	
	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	45,308,386.68	240,668.31	6,627,893.04	21,072.79

公司				
----	--	--	--	--

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

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 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

本基金于本期末未进行利润分配。

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
688599	天合光能	2020-06-02	2020-12-10	新股锁定	8.16	13.91	40,890	333,662.40	568,779.90	-
688159	有方科技	2020-01-16	2020-07-23	新股锁定	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新发流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新发流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-

688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新发流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
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	1,185	7,038.90	7,038.90	-
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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	145,182,060.00
合计	-	145,182,060.00

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2020年06月30日	2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	77,855,000.00
合计	-	77,855,000.00

6.4.13.2.3 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	44,960.00	48,692.00
AAA以下	-	-
未评级	10,033,000.00	-
合计	10,077,960.00	48,692.00

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0.35%。

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371,581,443.86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	45,308,386.68	-	-	-	45,308,386.68
结算备付金	1,159,032.87	-	-	-	1,159,032.87
存出保证金	131,449.34	-	-	-	131,449.34
交易性金融资产	10,033,000.00	-	44,960.00	316,241,619.61	326,319,579.61
应收证券清算款	-	-	-	890,860.49	890,860.49
应收利息	-	-	-	357,270.01	357,270.01
应收申购款	-	-	-	8,997.64	8,997.64
资产总计	56,631,868.89	-	44,960.00	317,498,747.75	374,175,576.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,967.31	27,967.31
应付管理人报酬	-	-	-	238,358.03	238,358.03
应付托管费	-	-	-	74,486.89	74,486.89
应付销售服务费	-	-	-	1,408.21	1,408.21

应付交易费用	-	-	-	101,190.55	101,190.55
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	98,481.05	98,481.05
负债总计	-	-	-	541,892.38	541,892.38
利率敏感度缺口	56,631,868.89	-	44,960.00	316,956,855.37	373,633,684.26
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	11,871,019.70	-	-	-	11,871,019.70
存出保证金	42,537.43	-	-	-	42,537.43
交易性金融资产	223,037,060.00	-	48,692.00	88,914,503.44	312,000,255.44
买入返售金融资产	39,960,179.94	-	-	-	39,960,179.94
应收利息	-	-	-	3,218,708.29	3,218,708.29
应收申购款	-	-	-	2,370.16	2,370.16
资产总计	274,910,797.07	-	48,692.00	92,135,581.89	367,095,070.96
负债					
卖出回购金融资产款	10,339,864.49	-	-	-	10,339,864.49
应付赎回款	-	-	-	6,441.93	6,441.93
应付管理人报酬	-	-	-	239,762.51	239,762.51
应付托管费	-	-	-	74,925.77	74,925.77
应付销售服务	-	-	-	2,140.69	2,140.69

费					
应付交易费用	-	-	-	19,445.82	19,445.82
应交税费	-	-	-	4,547.65	4,547.65
应付利息	-	-	-	7,654.01	7,654.01
其他负债	-	-	-	184,500.18	184,500.18
负债总计	10,339,864.49	-	-	539,418.56	10,879,283.05
利率敏感度缺口	264,570,932.58	-	48,692.00	91,596,163.33	356,215,787.91

表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合同约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

假设	除市场利率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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,519,028.19	-148,478.01
	市场利率下降25个基点	1,538,415.55	148,786.39

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	316,241,619.61	84.64	88,914,503.44	24.96
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	316,241,619.61	84.64	88,914,503.44	24.96

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%	17,317,930.52	3,325,712.55
	比较基准下降5%	-17,317,930.52	-3,325,712.55

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314,987,819.57

元，属于第二层次的余额为11,331,760.04元，无属于第三层次的余额（2019年12月31日：第一层次86,980,776.06元，第二层次225,019,479.38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	316,241,619.61	84.52
	其中：股票	316,241,619.61	84.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,077,960.00	2.69
	其中：债券	10,077,960.00	2.69
	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	46,467,419.55	12.42
8	其他各项资产	1,388,577.48	0.37
9	合计	374,175,576.64	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	5,232,000.00	1.40
B	采矿业	8,786,827.00	2.35
C	制造业	200,447,434.72	53.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,313,400.00	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	10,834,313.00	2.90
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,897,802.57	5.06
J	金融业	41,173,597.00	11.02
K	房地产业	14,761,258.00	3.95

L	租赁和商务服务业	11,782,221.00	3.15
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	316,241,619.61	84.64

7.3 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

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	000063	中兴通讯	539,800	21,662,174.00	5.80
2	600887	伊利股份	490,400	15,266,152.00	4.09
3	000002	万科A	564,700	14,761,258.00	3.95
4	600438	通威股份	837,500	14,555,750.00	3.90
5	002202	金风科技	1,321,739	13,177,737.83	3.53
6	600741	华域汽车	628,734	13,071,379.86	3.50
7	600031	三一重工	670,600	12,580,456.00	3.37
8	601318	中国平安	173,600	12,395,040.00	3.32
9	002027	分众传媒	2,115,300	11,782,221.00	3.15
10	300482	万孚生物	109,400	11,377,600.00	3.05
11	002422	科伦药业	540,100	11,342,100.00	3.04
12	300119	瑞普生物	503,400	11,250,990.00	3.01
13	601688	华泰证券	586,800	11,031,840.00	2.95
14	600258	首旅酒店	704,900	10,834,313.00	2.90

15	000001	平安银行	842,900	10,789,120.00	2.89
16	002065	东华软件	811,500	10,159,980.00	2.72
17	000876	新希望	308,800	9,202,240.00	2.46
18	000338	潍柴动力	659,900	9,053,828.00	2.42
19	000651	格力电器	155,700	8,807,949.00	2.36
20	601225	陕西煤业	1,218,700	8,786,827.00	2.35
21	600562	国睿科技	590,200	8,746,764.00	2.34
22	601877	正泰电器	331,300	8,729,755.00	2.34
23	600406	国电南瑞	430,900	8,725,725.00	2.34
24	600038	中直股份	206,700	8,489,169.00	2.27
25	002008	大族激光	232,800	8,369,160.00	2.24
26	601628	中国人寿	255,700	6,957,597.00	1.86
27	002035	华帝股份	642,300	6,506,499.00	1.74
28	300498	温氏股份	240,000	5,232,000.00	1.40
29	603939	益丰药房	47,400	4,313,400.00	1.15
30	000425	徐工机械	594,700	3,514,677.00	0.94
31	600346	恒力石化	235,100	3,291,400.00	0.88
32	688599	天合光能	40,890	568,779.90	0.15
33	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.05
34	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
35	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
36	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
37	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
38	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
39	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
40	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
41	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
42	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
43	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
44	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
45	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00

46	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
47	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
48	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600887	伊利股份	29,842,950.41	8.38
2	000063	中兴通讯	24,111,872.00	6.77
3	600438	通威股份	20,006,181.00	5.62
4	000651	格力电器	17,909,479.00	5.03
5	000002	万科A	15,342,475.00	4.31
6	600741	华域汽车	14,493,452.08	4.07
7	601318	中国平安	13,892,903.00	3.90
8	002202	金风科技	13,882,601.22	3.90
9	000425	徐工机械	13,548,388.96	3.80
10	002422	科伦药业	12,760,228.00	3.58
11	600031	三一重工	12,492,221.00	3.51
12	000001	平安银行	11,964,833.00	3.36
13	002027	分众传媒	11,701,506.64	3.28
14	600258	首旅酒店	11,507,724.00	3.23
15	600038	中直股份	11,254,729.00	3.16
16	002065	东华软件	10,171,029.00	2.86
17	601688	华泰证券	9,965,750.00	2.80
18	300119	瑞普生物	9,218,283.00	2.59
19	002008	大族激光	9,125,854.00	2.56
20	000338	潍柴动力	9,012,873.00	2.53
21	601225	陕西煤业	8,938,238.00	2.51
22	000876	新希望	8,823,287.00	2.48

23	300482	万孚生物	8,790,607.53	2.47
24	600562	国睿科技	8,606,091.84	2.42
25	601877	正泰电器	8,596,375.00	2.41
26	600406	国电南瑞	8,373,122.00	2.35

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	600887	伊利股份	16,469,119.00	4.62
2	000425	徐工机械	12,691,715.92	3.56
3	600438	通威股份	10,728,747.00	3.01
4	000651	格力电器	9,043,845.00	2.54
5	600872	中炬高新	8,443,708.32	2.37
6	000858	五粮液	8,036,716.00	2.26
7	002352	顺丰控股	7,559,825.00	2.12
8	002368	太极股份	7,356,629.00	2.07
9	601186	中国铁建	7,017,025.00	1.97
10	601888	中国中免	6,896,251.00	1.94
11	000681	视觉中国	6,670,858.00	1.87
12	300568	星源材质	6,391,843.00	1.79
13	300750	宁德时代	6,025,424.00	1.69
14	600233	圆通速递	3,837,830.00	1.08
15	000063	中兴通讯	3,551,938.00	1.00
16	001979	招商蛇口	3,405,669.14	0.96
17	600688	上海石化	3,371,947.96	0.95
18	600584	长电科技	3,307,397.00	0.93
19	600398	海澜之家	3,228,513.00	0.91
20	600038	中直股份	2,729,003.00	0.77

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	442,665,036.03
卖出股票收入（成交）总额	233,191,308.16

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	10,033,000.00	2.69
	其中：政策性金融债	10,033,000.00	2.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	44,960.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,077,960.00	2.70

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	170411	17农发11	100,000	10,033,000.00	2.69
2	110061	川投转债	400	44,960.00	0.01

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**

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金没有参与股指期货投资。

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，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、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	131,449.34

2	应收证券清算款	890,860.49
3	应收股利	-
4	应收利息	357,270.01
5	应收申购款	8,997.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,388,577.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110061	川投转债	44,960.00	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信价值	235	1,570,179.26	367,643,814.88	99.63%	1,348,310.13	0.37%

红利混合A						
创金合信价值红利混合C	227	8,849.45	0.00	0.00%	2,008,824.75	100.00%
合计	443	837,473.93	367,643,814.88	99.10%	3,357,134.88	0.90%

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	创金合信价值红利混合A	9.99	0.00%
	创金合信价值红利混合C	0.00	0.00%
	合计	9.99	0.00%

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	创金合信价值红利混合A	0
	创金合信价值红利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信价值红利混合A	0
	创金合信价值红利混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信价值红利混合 A	创金合信价值红利混合 C
基金合同生效日(2018年04月23日)基金份额总额	28,472,141.72	325,682,443.28
本报告期期初基金份额总额	369,334,453.99	3,091,952.19
本报告期基金总申购份额	423,520.12	842,322.06
减：本报告期基金总赎回份额	765,849.10	1,925,449.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	368,992,125.01	2,008,824.75

§ 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	89,366,693.98	13.38%	28,445.56	7.99%	-
第一创业证券	2	352,506,145.62	52.80%	254,780.94	71.57%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	53,746,563.00	8.05%	17,189.47	4.83%	-
中信建投证券	2	172,061,756.88	25.77%	55,555.52	15.61%	-

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

本基金报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金2019年第四季度报告	公司官网、中国证券报	2020-01-17
2	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金2020年第一季度报告	公司官网、中国证券报	2020-04-21
3	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告	公司官网、中国证券报	2020-04-30
4	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报	2020-05-09
5	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金（2020年5月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2020-05-13
6	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金（2020	公司官网、中国证券报	2020-05-13

	年5月) 招募说明书(更新)摘要		
7	创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金2020年第二季度报告	公司官网、中国证券报	2020-07-21

§ 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 - 20200630	91,910,683.39	0.00	0.00	91,910,683.39	24.77%
	2	20200101 - 20200630	183,822,448.10	0.00	0.00	183,822,448.10	49.55%
	3	20200101 - 20200630	91,910,683.39	0.00	0.00	91,910,683.39	24.77%
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 (1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险; (2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响; (3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作; (4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。</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、《创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信价值红利灵活配置混合型证券投资基金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