
创金合信国证 2000 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	6
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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61
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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

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.....	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信国证2000指数	
基金主代码	005565	
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	10,815,517.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
下属分级基金的交易代码	005565	005566
报告期末下属分级基金的份额总额	5,156,137.50份	5,659,380.48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	国证2000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	证券时报
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

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)
---------------	------------------------------

	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C
本期已实现收益	318,460.80	337,786.34
本期利润	597,791.64	668,633.60
加权平均基金份额本期利润	0.1126	0.1137
本期加权平均净值利润率	11.19%	11.33%
本期基金份额净值增长率	11.56%	11.45%
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	33,538.68	16,976.24
期末可供分配基金份额利润	0.0065	0.0030
期末基金资产净值	5,526,091.28	6,043,705.55
期末基金份额净值	1.0718	1.0679
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	7.18%	6.79%

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

创金合信国证2000指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.80%	0.79%	7.05%	0.83%	-0.25%	-0.04%

过去三个月	11.93%	1.09%	12.46%	1.14%	-0.53%	-0.05%
过去六个月	11.56%	1.71%	10.74%	1.74%	0.82%	-0.03%
过去一年	13.95%	1.43%	13.60%	1.45%	0.35%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.18%	1.51%	4.86%	1.52%	2.32%	-0.01%

创金合信国证2000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	6.77%	0.79%	7.05%	0.83%	-0.28%	-0.04%
过去三个月	11.87%	1.09%	12.46%	1.14%	-0.59%	-0.05%
过去六个月	11.45%	1.71%	10.74%	1.74%	0.71%	-0.03%
过去一年	13.72%	1.43%	13.60%	1.45%	0.12%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.79%	1.51%	4.86%	1.52%	1.93%	-0.01%

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。

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国证2000指数，业绩基准为国证2000指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率（税后） \times 5%。国证2000指数的样本股由：在深圳、上海证券交易所上市的除ST、*ST股票外，按照市值和成交金额在市场中所占比例的综合排名，扣除国证1000指数样本股后，排名靠前的2000只股票构成。该指数于2014年3月28日发布，用以反映A股市场小盘股票的价格变动趋势。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。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证2000指数A基金份额净值为1.0718元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.56%，同期业绩比较基准收益率为10.74%；截至报告期末创金合信国证2000指数C基金份额净值为1.0679元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.45%，同期业绩比较基准收益率为10.74%。

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年下半年，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: 创金合信国证2000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	401,480.24	370,513.35
结算备付金		-	19,655.16
存出保证金		723.36	564.02
交易性金融资产	6.4.7.2	11,152,002.68	10,368,897.65
其中: 股票投资		10,921,657.68	10,137,172.65
基金投资		-	-
债券投资		230,345.00	231,725.00
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		42,853.29	-
应收利息	6.4.7.5	7,384.95	3,452.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	4,490.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,604,444.52	10,767,572.88
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		221.85	6,588.92
应付管理人报酬		4,781.86	4,427.04
应付托管费		956.35	885.41
应付销售服务费		1,019.91	905.94
应付交易费用	6.4.7.7	1,874.64	2,082.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	25,793.08	38,002.59
负债合计		34,647.69	52,892.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	10,815,517.98	11,167,713.45
未分配利润	6.4.7.10	754,278.85	-453,032.95

所有者权益合计		11,569,796.83	10,714,680.50
负债和所有者权益总计		11,604,444.52	10,767,572.88

报告截止日2020年06月30日，基金份额总额10,815,517.98份，其中下属A类基金份额5,156,137.50份，C类基金份额5,659,380.48份。下属A类基金份额净值1.0718元，C类基金份额净值1.0679元。

6.2 利润表

会计主体：创金合信国证2000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		1,362,420.87	2,163,838.30
1. 利息收入		5,392.52	6,515.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,412.01	1,278.94
债券利息收入		3,980.51	5,236.57
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）		733,012.52	920,180.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	653,083.44	835,523.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-994.51
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	79,929.08	85,650.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	610,178.10	1,227,851.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,837.73	9,290.85
减：二、费用		95,995.63	91,072.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	27,870.55	26,077.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,574.04	5,215.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,844.68	5,525.68
4. 交易费用	6.4.7.17	22,372.86	22,777.46
5. 利息支出		20.42	-
其中：卖出回购金融资产支出		20.42	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.18	34,313.08	31,476.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,266,425.24	2,072,766.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,266,425.24	2,072,766.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信国证2000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)	11,167,713.45	-453,032.95	10,714,680.50
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	1,266,425.24	1,266,425.24
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)	-352,195.47	-59,113.44	-411,308.91
其中: 1. 基金申购款	3,435,845.54	7,140.52	3,442,986.06
2. 基金赎回 款	-3,788,041.01	-66,253.96	-3,854,294.97
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)	10,815,517.98	754,278.85	11,569,796.83
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)	11,713,349.42	-2,847,582.74	8,865,766.68
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	2,072,766.06	2,072,766.06
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-347,775.13	90,599.28	-257,175.85
其中: 1. 基金申购款	2,904,915.90	-69,805.29	2,835,110.61

2. 基金赎回款	-3, 252, 691. 03	160, 404. 57	-3, 092, 286. 46
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）	11, 365, 574. 29	-684, 217. 40	10, 681, 356. 89

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

创金合信国证2000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]2452号《关于准予创金合信国证2000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《创金合信国证2000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10,057,233.57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0028号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信国证2000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10,057,640.00份基金份额,其中认购资金利息折合406.43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10,000,400.04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《创金合信国证2000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《创金合信国证2000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：国证2000指数收益率×95% + 银行人民币活期存款利率（税后）×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<年度报告和半年度报告>》、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》、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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[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费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	401,480.24

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	401,480.24

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		10,064,229.63	10,921,657.68	857,428.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	231,817.00	230,345.00	-1,472.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	231,817.00	230,345.00	-1,472.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,296,046.63	11,152,002.68	855,956.05

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	39.40
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	-
应收债券利息	7,345.25
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	0.30
合计	7,384.95

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	1,874.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,874.64

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	-
预提费用	25,793.08
合计	25,793.08

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信国证2000指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000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	5,424,427.08	5,424,427.08
本期申购	461,241.98	461,241.98
本期赎回(以“-”号填列)	-729,531.56	-729,531.56
本期末	5,156,137.50	5,156,137.50

6.4.7.9.2 创金合信国证2000指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000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	5,743,286.37	5,743,286.37
本期申购	2,974,603.56	2,974,603.56
本期赎回(以“-”号填列)	-3,058,509.45	-3,058,509.45
本期末	5,659,380.48	5,659,380.48

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 创金合信国证2000指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-289,846.95	76,723.18	-213,123.77

本期利润	318,460.80	279,330.84	597,791.64
本期基金份额交易产生的变动数	4,924.83	-19,638.92	-14,714.09
其中：基金申购款	-12,795.12	13,239.59	444.47
基金赎回款	17,719.95	-32,878.51	-15,158.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,538.68	336,415.10	369,953.78

6.4.7.10.2 创金合信国证2000指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信国证2000指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-320,183.85	80,274.67	-239,909.18
本期利润	337,786.34	330,847.26	668,633.60
本期基金份额交易产生的变动数	-626.25	-43,773.10	-44,399.35
其中：基金申购款	-80,031.21	86,727.26	6,696.05
基金赎回款	79,404.96	-130,500.36	-51,095.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,976.24	367,348.83	384,325.07

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	1,257.57
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	149.40
其他	5.04
合计	1,412.01

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	12,424,845.73
减：卖出股票成本总额	11,771,762.29
买卖股票差价收入	653,083.44

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 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	79,929.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	79,929.08

6.4.7.15 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	610,178.10
——股票投资	611,558.10
——债券投资	-1,380.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——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	610,178.10

6.4.7.16 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	13,815.40
转换费收入	22.33
合计	13,837.73

6.4.7.17 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	22,372.86
银行间市场交易费用	-
合计	22,372.86

6.4.7.18 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	17,793.08
信息披露费	-
汇划手续费	520.00

指数使用费	16,000.00
合计	34,313.08

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

创金合信国证2000指数发起式证券投资基金自2020年07月02日起进入清算期; 2020年08月05日,披露《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金清算报告》。

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	-	-	17,238,607.93	99.88%

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	-	-	661,058.80	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	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	12,390.64	99.94%	7,383.48	100.00%

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	27,870.55	26,077.24
其中：支付销售机构的客户维护费	1,227.03	1,398.94

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 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托管费	5,574.04	5,215.47

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		
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C	合计
第一创业证券	0.00	42.58	42.58
招商银行	0.00	1.18	1.18
创金合信直销	0.00	5,030.33	5,030.33
合计	0.00	5,074.09	5,074.09
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		
	创金合信国证2000指数A	创金合信国证2000指数C	合计
创金合信直销	0.00	4,562.40	4,562.40
合计	0.00	4,562.40	4,562.40

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日的基金资产净值销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理

人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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

创金合信国证2000指数A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	5,000,200.04	5,000,200.04
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	5,000,200.04	5,000,200.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	96.98%	90.56%

创金合信国证2000指数C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	5,000,200.00	5,000,200.00
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	5,000,200.00	5,000,200.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	88.35%	85.56%
---------------------	--------	--------

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
招商银行股份有限公司	401,480.24	1,257.57	343,076.49	1,131.41

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	-----	-------	--------	--------	----

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
0022 54	泰和 新材	2020 -06- 29	重大 事项 停牌	13.6 0	2020 -07- 14	14.9 6	3,300	37,214.29	44,880.00	-
0028 19	东方 中科	2020 -06- 29	重大 事项 停牌	25.9 2	2020 -07- 08	28.4 6	900	21,620.70	23,328.00	-

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	230,345.00	231,725.00
合计	230,345.00	231,725.00

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

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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，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0.59%。

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11,535,473.46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	401,480.24	-	-	-	401,480.24
存出保证金	723.36	-	-	-	723.36
交易性金融资产	230,345.00	-	-	10,921,657.68	11,152,002.68
应收证券清算款	-	-	-	42,853.29	42,853.29
应收利息	-	-	-	7,384.95	7,384.95
资产总计	632,548.60	-	-	10,971,895.92	11,604,444.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	221.85	221.85
应付管理人报酬	-	-	-	4,781.86	4,781.86
应付托管费	-	-	-	956.35	956.35
应付销售服务费	-	-	-	1,019.91	1,019.91
应付交易费用	-	-	-	1,874.64	1,874.64
其他负债	-	-	-	25,793.08	25,793.08
负债总计	-	-	-	34,647.69	34,647.69
利率敏感度缺口	632,548.60	-	-	10,937,248.23	11,569,796.83

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	370,513.35	-	-	-	370,513.35
结算备付金	19,655.16	-	-	-	19,655.16
存出保证金	564.02	-	-	-	564.02
交易性金融资产	231,725.00	-	-	10,137,172.65	10,368,897.65
应收利息	-	-	-	3,452.68	3,452.68
应收申购款	-	-	-	4,490.02	4,490.02
资产总计	622,457.53	-	-	10,145,115.35	10,767,572.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,588.92	6,588.92
应付管理人报酬	-	-	-	4,427.04	4,427.04
应付托管费	-	-	-	885.41	885.41
应付销售服务费	-	-	-	905.94	905.94
应付交易费用	-	-	-	2,082.48	2,082.48
其他负债	-	-	-	38,002.59	38,002.59
负债总计	-	-	-	52,892.38	52,892.38
利率敏感度缺口	622,457.53	-	-	10,092,222.97	10,714,680.50

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1.99%(2019年12月31日：2.16%)，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	10,921,657.68	94.40	10,137,172.65	94.61
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	10,921,657.68	94.40	10,137,172.65	94.61

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%	536,913.81	512,238.50
	比较基准下降5%	-536,913.81	-512,238.50

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10,853,449.68元，属于第二层次的余额为298,553.00元，无属于第三层次的余额（2019年12月31日：第一层次10,107,907.65元，第二层次260,990.00元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整

中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于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	10,921,657.68	94.12
	其中：股票	10,921,657.68	94.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	230,345.00	1.98
	其中：债券	230,345.00	1.98
	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	401,480.24	3.46
8	其他各项资产	50,961.60	0.44
9	合计	11,604,444.52	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	83,893.50	0.73
B	采矿业	44,028.00	0.38
C	制造业	7,472,415.56	64.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	233,312.00	2.02
E	建筑业	239,617.00	2.07
F	批发和零售业	461,218.60	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	244,345.00	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	891,068.62	7.70
J	金融业	39,722.00	0.34
K	房地产业	342,038.00	2.96
L	租赁和商务服务业	99,784.60	0.86
M	科学研究和技术服务业	225,759.50	1.95
N	水利、环境和公共设施管理业	195,507.50	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	50,814.80	0.44
Q	卫生和社会工作	20,148.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	152,508.00	1.32
S	综合	125,477.00	1.08
	合计	10,921,657.68	94.40

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	603906	龙蟠科技	4,600	71,760.00	0.62
2	000913	钱江摩托	5,200	70,044.00	0.61
3	000011	深物业A	4,300	68,800.00	0.59
4	300453	三鑫医疗	3,500	68,040.00	0.59
5	603520	司太立	740	62,204.40	0.54
6	300016	北陆药业	4,800	58,368.00	0.50
7	300659	中孚信息	960	57,619.20	0.50
8	603128	华贸物流	9,800	56,938.00	0.49
9	002031	巨轮智能	29,600	55,352.00	0.48
10	000612	焦作万方	10,500	54,705.00	0.47
11	600382	广东明珠	8,200	53,628.00	0.46
12	300502	新易盛	840	53,020.80	0.46
13	603387	基蛋生物	1,300	52,377.00	0.45
14	603315	福鞍股份	4,000	52,240.00	0.45
15	002243	通产丽星	3,600	51,840.00	0.45
16	300692	中环环保	4,100	51,496.00	0.45
17	603166	福达股份	8,100	51,435.00	0.44
18	000514	渝开发	13,300	50,806.00	0.44
19	000529	广弘控股	6,800	50,048.00	0.43
20	603258	电魂网络	900	50,004.00	0.43
21	600984	建设机械	2,000	49,600.00	0.43
22	002531	天顺风能	8,200	49,036.00	0.42
23	603308	应流股份	2,400	48,960.00	0.42

24	002847	盐津铺子	500	47,610.00	0.41
25	600693	东百集团	9,700	47,045.00	0.41
26	300043	星辉娱乐	11,700	46,800.00	0.40
27	300639	凯普生物	900	46,737.00	0.40
28	600993	马应龙	1,900	46,075.00	0.40
29	300552	万集科技	1,080	45,986.40	0.40
30	300563	神宇股份	1,400	45,822.00	0.40
31	002498	汉缆股份	9,800	45,668.00	0.39
32	002204	大连重工	10,500	45,150.00	0.39
33	002254	泰和新材	3,300	44,880.00	0.39
34	002928	华夏航空	2,900	43,645.00	0.38
35	300277	海联讯	3,000	43,410.00	0.38
36	600510	黑牡丹	5,500	43,340.00	0.37
37	002860	星帅尔	2,720	43,248.00	0.37
38	300235	方直科技	2,600	42,952.00	0.37
39	300468	四方精创	1,801	42,683.70	0.37
40	300702	天宇股份	400	42,528.00	0.37
41	600199	金种子酒	6,500	42,380.00	0.37
42	002402	和而泰	2,600	42,146.00	0.36
43	002578	闽发铝业	12,000	41,880.00	0.36
44	002605	姚记科技	1,100	41,800.00	0.36
45	300041	回天新材	2,700	40,959.00	0.35
46	603208	江山欧派	420	40,908.00	0.35
47	002079	苏州固锝	3,100	40,827.00	0.35
48	300497	富祥药业	2,080	40,705.60	0.35
49	002481	双塔食品	2,300	39,836.00	0.34
50	002869	金溢科技	600	39,648.00	0.34
51	603977	国泰集团	5,040	39,110.40	0.34
52	600846	同济科技	4,600	39,100.00	0.34
53	603385	惠达卫浴	2,800	38,584.00	0.33
54	000042	中洲控股	3,800	38,228.00	0.33

55	601677	明泰铝业	4,400	38,192.00	0.33
56	603987	康德莱	2,200	38,082.00	0.33
57	603966	法兰泰克	3,800	37,544.00	0.32
58	300543	朗科智能	2,620	36,968.20	0.32
59	002214	大立科技	1,300	36,634.00	0.32
60	603856	东宏股份	2,500	36,000.00	0.31
61	600617	国新能源	9,200	35,972.00	0.31
62	300327	中颖电子	1,110	35,964.00	0.31
63	000965	天保基建	11,000	35,750.00	0.31
64	300500	启迪设计	2,600	35,698.00	0.31
65	600218	全柴动力	4,000	35,680.00	0.31
66	002332	仙琚制药	2,100	35,364.00	0.31
67	600603	广汇物流	7,500	35,325.00	0.31
68	002182	云海金属	3,700	35,298.00	0.31
69	603887	城地股份	1,440	35,136.00	0.30
70	300246	宝莱特	1,000	35,080.00	0.30
71	603018	中设集团	3,600	35,028.00	0.30
72	603797	联泰环保	3,000	34,470.00	0.30
73	603819	神力股份	3,250	34,450.00	0.30
74	601058	赛轮轮胎	9,700	34,241.00	0.30
75	603012	创力集团	4,800	34,224.00	0.30
76	603129	春风动力	500	34,105.00	0.29
77	300593	新雷能	2,200	34,056.00	0.29
78	002877	智能自控	4,700	34,028.00	0.29
79	603136	天目湖	1,400	33,880.00	0.29
80	300737	科顺股份	1,700	33,541.00	0.29
81	002832	比音勒芬	1,955	33,469.60	0.29
82	603197	保隆科技	1,130	33,425.40	0.29
83	300480	光力科技	2,210	33,393.10	0.29
84	002822	中装建设	3,900	33,384.00	0.29
85	600731	湖南海利	4,700	33,370.00	0.29

86	300660	江苏雷利	1,900	33,326.00	0.29
87	600963	岳阳林纸	9,260	32,873.00	0.28
88	002879	长缆科技	2,100	32,592.00	0.28
89	000802	北京文化	5,300	32,489.00	0.28
90	603123	翠微股份	4,300	32,250.00	0.28
91	300417	南华仪器	1,770	32,001.60	0.28
92	002161	远望谷	4,000	32,000.00	0.28
93	601890	亚星锚链	5,900	31,919.00	0.28
94	600239	云南城投	8,300	31,789.00	0.27
95	000551	创元科技	3,200	31,424.00	0.27
96	600135	乐凯胶片	4,800	31,392.00	0.27
97	601330	绿色动力	3,300	31,350.00	0.27
98	300701	森霸传感	900	31,347.00	0.27
99	600169	太原重工	16,300	31,133.00	0.27
100	002100	天康生物	1,900	30,590.00	0.26
101	603368	柳药股份	1,316	30,202.20	0.26
102	000543	皖能电力	7,500	30,150.00	0.26
103	603336	宏辉果蔬	2,465	29,604.65	0.26
104	002400	省广集团	2,800	29,372.00	0.25
105	603989	艾华集团	1,000	29,020.00	0.25
106	300573	兴齐眼药	200	29,000.00	0.25
107	600613	神奇制药	4,300	28,939.00	0.25
108	002909	集泰股份	3,220	28,851.20	0.25
109	600020	中原高速	8,100	28,674.00	0.25
110	300579	数字认证	700	28,511.00	0.25
111	002277	友阿股份	7,100	28,400.00	0.25
112	002621	美吉姆	4,620	28,366.80	0.25
113	300259	新天科技	4,900	28,322.00	0.24
114	002895	川恒股份	2,300	28,152.00	0.24
115	002662	京威股份	8,400	28,056.00	0.24
116	000622	恒立实业	7,500	28,050.00	0.24

117	002587	奥拓电子	4,900	27,930.00	0.24
118	603886	元祖股份	1,700	27,880.00	0.24
119	300541	先进数通	1,560	27,783.60	0.24
120	300571	平治信息	600	27,720.00	0.24
121	300303	聚飞光电	4,700	27,683.00	0.24
122	000026	飞亚达	3,100	27,683.00	0.24
123	300114	中航电测	2,400	27,384.00	0.24
124	603859	能科股份	800	27,328.00	0.24
125	002675	东诚药业	1,300	27,235.00	0.24
126	002276	万马股份	3,800	27,132.00	0.23
127	600063	皖维高新	8,300	27,058.00	0.23
128	300326	凯利泰	929	27,033.90	0.23
129	300429	强力新材	1,500	26,820.00	0.23
130	002307	北新路桥	4,500	26,820.00	0.23
131	600433	冠豪高新	8,900	26,789.00	0.23
132	603801	志邦家居	1,000	26,690.00	0.23
133	002234	民和股份	1,200	26,616.00	0.23
134	000923	河钢资源	2,100	26,460.00	0.23
135	002521	齐峰新材	5,000	26,400.00	0.23
136	300487	蓝晓科技	800	26,304.00	0.23
137	300715	凯伦股份	700	26,096.00	0.23
138	300066	三川智慧	5,300	26,076.00	0.23
139	300440	运达科技	2,600	26,026.00	0.22
140	002851	麦格米特	1,000	25,920.00	0.22
141	300624	万兴科技	320	25,760.00	0.22
142	300559	佳发教育	1,200	25,464.00	0.22
143	300021	大禹节水	5,800	25,462.00	0.22
144	002734	利民股份	1,690	25,299.30	0.22
145	002695	煌上煌	1,000	25,220.00	0.22
146	002066	瑞泰科技	2,500	25,075.00	0.22
147	601137	博威合金	1,600	25,024.00	0.22

148	300690	双一科技	1,000	25,010.00	0.22
149	300709	精研科技	260	24,999.00	0.22
150	600223	鲁商发展	2,600	24,960.00	0.22
151	603186	华正新材	500	24,885.00	0.22
152	300130	新国都	1,800	24,750.00	0.21
153	601107	四川成渝	7,300	24,747.00	0.21
154	002873	新天药业	1,300	24,544.00	0.21
155	603360	百傲化学	1,260	24,481.80	0.21
156	000567	海德股份	1,900	24,434.00	0.21
157	300194	福安药业	4,600	24,426.00	0.21
158	002231	奥维通信	3,600	24,336.00	0.21
159	002111	威海广泰	1,700	24,225.00	0.21
160	600187	国中水务	11,000	24,200.00	0.21
161	300572	安车检测	380	24,149.00	0.21
162	603579	荣泰健康	900	24,138.00	0.21
163	002457	青龙管业	3,100	24,025.00	0.21
164	600478	科力远	5,100	24,021.00	0.21
165	600227	圣济堂	8,900	23,941.00	0.21
166	002216	三全食品	1,000	23,900.00	0.21
167	002487	大金重工	4,000	23,840.00	0.21
168	300394	天孚通信	400	23,820.00	0.21
169	002114	罗平锌电	3,400	23,800.00	0.21
170	002308	威创股份	3,500	23,765.00	0.21
171	600217	中再资环	4,900	23,618.00	0.20
172	603679	华体科技	600	23,586.00	0.20
173	001896	豫能控股	7,300	23,506.00	0.20
174	002819	东方中科	900	23,328.00	0.20
175	002351	漫步者	1,100	23,232.00	0.20
176	300213	佳讯飞鸿	3,600	23,220.00	0.20
177	601700	风范股份	4,400	23,144.00	0.20
178	603458	勘设股份	1,100	22,880.00	0.20

179	002619	艾格拉斯	9,200	22,816.00	0.20
180	002139	拓邦股份	4,050	22,801.50	0.20
181	300384	三联虹普	1,300	22,724.00	0.20
182	600327	大东方	5,800	22,678.00	0.20
183	002644	佛慈制药	2,700	22,545.00	0.19
184	300537	广信材料	1,200	22,524.00	0.19
185	000733	振华科技	1,000	22,490.00	0.19
186	600730	中国高科	4,600	22,448.00	0.19
187	600880	博瑞传播	4,800	22,224.00	0.19
188	600986	科达股份	4,600	22,218.00	0.19
189	300183	东软载波	1,400	21,966.00	0.19
190	002726	龙大肉食	2,600	21,944.00	0.19
191	300192	科斯伍德	1,300	21,944.00	0.19
192	300719	安达维尔	1,900	21,926.00	0.19
193	002084	海鸥住工	2,420	21,901.00	0.19
194	300205	天喻信息	2,100	21,840.00	0.19
195	603699	纽威股份	1,400	21,812.00	0.19
196	002657	中科金财	1,400	21,742.00	0.19
197	002706	良信电器	1,300	21,684.00	0.19
198	300686	智动力	900	21,654.00	0.19
199	603365	水星家纺	1,500	21,645.00	0.19
200	603039	泛微网络	280	21,632.80	0.19
201	300674	宇信科技	500	21,575.00	0.19
202	600190	锦州港	7,100	21,513.00	0.19
203	000532	华金资本	1,800	21,492.00	0.19
204	600422	昆药集团	2,200	21,472.00	0.19
205	603611	诺力股份	1,000	21,460.00	0.19
206	002226	江南化工	3,700	21,349.00	0.18
207	002107	沃华医药	1,920	21,312.00	0.18
208	603108	润达医疗	1,600	21,312.00	0.18
209	000023	深天地 A	1,300	21,034.00	0.18

210	300236	上海新阳	350	21,021.00	0.18
211	300363	博腾股份	600	20,736.00	0.18
212	603690	至纯科技	500	20,690.00	0.18
213	300672	国科微	400	20,564.00	0.18
214	000810	创维数字	1,700	20,536.00	0.18
215	002891	中宠股份	500	20,440.00	0.18
216	002838	道恩股份	700	20,433.00	0.18
217	600710	苏美达	4,700	20,398.00	0.18
218	300613	富瀚微	180	20,394.00	0.18
219	603538	美诺华	400	20,392.00	0.18
220	603696	安记食品	1,400	20,188.00	0.17
221	600896	览海医疗	4,600	20,148.00	0.17
222	002452	长高集团	3,000	20,100.00	0.17
223	002398	垒知集团	1,900	20,083.00	0.17
224	002865	钧达股份	1,500	20,070.00	0.17
225	300697	电工合金	1,500	19,965.00	0.17
226	002172	澳洋健康	8,000	19,840.00	0.17
227	603920	世运电路	800	19,832.00	0.17
228	002664	长鹰信质	1,500	19,830.00	0.17
229	300248	新开普	1,600	19,776.00	0.17
230	002397	梦洁股份	3,300	19,668.00	0.17
231	300738	奥飞数据	340	19,611.20	0.17
232	000049	德赛电池	400	19,604.00	0.17
233	600313	农发种业	5,500	19,580.00	0.17
234	300123	亚光科技	1,700	19,499.00	0.17
235	600557	康缘药业	1,400	19,488.00	0.17
236	600222	太龙药业	3,300	19,470.00	0.17
237	603309	维力医疗	1,430	19,319.30	0.17
238	300481	濮阳惠成	1,000	19,280.00	0.17
239	000601	韶能股份	3,600	18,972.00	0.16
240	603017	中衡设计	1,800	18,936.00	0.16

241	300226	上海钢联	240	18,864.00	0.16
242	300179	四方达	3,300	18,711.00	0.16
243	603026	石大胜华	700	18,683.00	0.16
244	002326	永太科技	1,521	18,647.46	0.16
245	002526	山东矿机	7,800	18,642.00	0.16
246	002639	雪人股份	2,700	18,630.00	0.16
247	603227	雪峰科技	5,000	18,600.00	0.16
248	002045	国光电器	1,900	18,544.00	0.16
249	300215	电科院	3,000	18,540.00	0.16
250	002927	泰永长征	1,482	18,480.54	0.16
251	603519	立霸股份	1,400	18,424.00	0.16
252	300375	鹏翎股份	5,100	18,411.00	0.16
253	300042	朗科科技	1,100	18,348.00	0.16
254	002930	宏川智慧	1,300	18,291.00	0.16
255	603318	派思股份	2,400	18,240.00	0.16
256	002628	成都路桥	4,700	18,189.00	0.16
257	000812	陕西金叶	6,400	18,176.00	0.16
258	000888	峨眉山 A	3,200	18,112.00	0.16
259	300735	光弘科技	980	18,081.00	0.16
260	002149	西部材料	2,600	17,966.00	0.16
261	600136	当代文体	2,200	17,952.00	0.16
262	603218	日月股份	980	17,934.00	0.16
263	002835	同为股份	1,600	17,920.00	0.15
264	002446	盛路通信	2,500	17,875.00	0.15
265	300109	新开源	1,200	17,772.00	0.15
266	600496	精工钢构	5,300	17,755.00	0.15
267	300050	世纪鼎利	3,500	17,710.00	0.15
268	300101	振芯科技	1,600	17,680.00	0.15
269	603596	伯特利	500	17,600.00	0.15
270	002377	国创高新	4,500	17,595.00	0.15
271	000544	中原环保	2,700	17,577.00	0.15

272	601969	海南矿业	3,600	17,568.00	0.15
273	603300	华铁应急	2,960	17,552.80	0.15
274	300443	金雷股份	900	17,505.00	0.15
275	002641	永高股份	2,600	17,446.00	0.15
276	002194	武汉凡谷	840	17,388.00	0.15
277	600316	洪都航空	1,100	17,380.00	0.15
278	002154	报喜鸟	5,600	17,360.00	0.15
279	300320	海达股份	3,300	17,358.00	0.15
280	300379	东方通	400	17,212.00	0.15
281	600983	惠而浦	3,600	17,100.00	0.15
282	002298	中电兴发	2,100	17,073.00	0.15
283	600343	航天动力	2,200	17,072.00	0.15
284	002796	世嘉科技	800	16,920.00	0.15
285	600381	青海春天	3,300	16,863.00	0.15
286	002300	太阳电缆	2,600	16,848.00	0.15
287	601028	玉龙股份	1,400	16,842.00	0.15
288	600533	栖霞建设	4,600	16,836.00	0.15
289	000539	粤电力 A	4,900	16,611.00	0.14
290	002367	康力电梯	1,900	16,587.00	0.14
291	600072	中船科技	1,500	16,470.00	0.14
292	002655	共达电声	1,300	16,458.00	0.14
293	000882	华联股份	8,700	16,443.00	0.14
294	300504	天邑股份	600	16,380.00	0.14
295	300128	锦富技术	5,300	16,271.00	0.14
296	300577	开润股份	600	16,182.00	0.14
297	300225	金力泰	2,500	16,175.00	0.14
298	300140	中环装备	1,800	16,164.00	0.14
299	603068	博通集成	200	16,116.00	0.14
300	603303	得邦照明	1,500	16,080.00	0.14
301	002818	富森美	1,300	15,990.00	0.14
302	600449	宁夏建材	1,300	15,886.00	0.14

303	002171	楚江新材	1,700	15,878.00	0.14
304	002876	三利谱	300	15,870.00	0.14
305	603577	汇金通	1,540	15,815.80	0.14
306	002328	新朋股份	2,700	15,795.00	0.14
307	002579	中京电子	1,100	15,730.00	0.14
308	603466	风语筑	800	15,576.00	0.13
309	603999	读者传媒	2,600	15,470.00	0.13
310	002618	丹邦科技	1,600	15,440.00	0.13
311	002538	司尔特	3,200	15,392.00	0.13
312	300228	富瑞特装	3,900	15,366.00	0.13
313	600765	中航重机	1,500	15,330.00	0.13
314	002646	青青稞酒	1,400	15,302.00	0.13
315	600318	新力金融	1,200	15,288.00	0.13
316	300569	天能重工	1,870	15,259.20	0.13
317	002746	仙坛股份	1,150	15,237.50	0.13
318	300664	鹏鹞环保	1,650	15,229.50	0.13
319	603045	福达合金	1,100	15,213.00	0.13
320	603033	三维股份	700	15,204.00	0.13
321	002467	二六三	2,160	15,184.80	0.13
322	002177	御银股份	3,600	15,120.00	0.13
323	300034	钢研高纳	800	15,008.00	0.13
324	600876	洛阳玻璃	1,100	14,883.00	0.13
325	000682	东方电子	3,000	14,880.00	0.13
326	002733	雄韬股份	700	14,875.00	0.13
327	002119	康强电子	1,200	14,868.00	0.13
328	600033	福建高速	5,600	14,840.00	0.13
329	002864	盘龙药业	500	14,790.00	0.13
330	000407	胜利股份	4,600	14,766.00	0.13
331	300055	万邦达	2,400	14,688.00	0.13
332	300206	理邦仪器	800	14,592.00	0.13
333	601011	宝泰隆	3,800	14,516.00	0.13

334	000099	中信海直	2,100	14,511.00	0.13
335	002539	云图控股	2,100	14,490.00	0.13
336	600735	新华锦	2,600	14,482.00	0.13
337	002106	莱宝高科	1,100	14,454.00	0.12
338	603301	振德医疗	280	14,434.00	0.12
339	000599	青岛双星	3,400	14,416.00	0.12
340	002591	恒大高新	1,900	14,364.00	0.12
341	002022	科华生物	800	14,360.00	0.12
342	603586	金麒麟	900	14,283.00	0.12
343	601811	新华文轩	1,400	14,238.00	0.12
344	002697	红旗连锁	1,300	14,196.00	0.12
345	000757	浩物股份	3,300	14,157.00	0.12
346	002634	棒杰股份	2,400	14,088.00	0.12
347	603060	国检集团	700	13,993.00	0.12
348	600624	复旦复华	1,400	13,986.00	0.12
349	300726	宏达电子	500	13,905.00	0.12
350	603663	三祥新材	1,000	13,880.00	0.12
351	300465	高伟达	1,000	13,880.00	0.12
352	300479	神思电子	900	13,860.00	0.12
353	002850	科达利	200	13,840.00	0.12
354	002404	嘉欣丝绸	2,100	13,797.00	0.12
355	300005	探路者	3,600	13,716.00	0.12
356	000751	锌业股份	5,300	13,674.00	0.12
357	600773	西藏城投	2,300	13,662.00	0.12
358	002853	皮阿诺	600	13,608.00	0.12
359	600326	西藏天路	1,900	13,528.00	0.12
360	603063	禾望电气	1,900	13,528.00	0.12
361	000521	长虹美菱	4,600	13,524.00	0.12
362	600819	耀皮玻璃	3,000	13,470.00	0.12
363	000859	国风塑业	2,400	13,440.00	0.12
364	300586	美联新材	1,520	13,421.60	0.12

365	603843	正平股份	2,800	13,412.00	0.12
366	600191	华资实业	2,300	13,363.00	0.12
367	002432	九安医疗	1,200	13,356.00	0.12
368	002880	卫光生物	200	13,336.00	0.12
369	300319	麦捷科技	1,200	13,332.00	0.12
370	300568	星源材质	716	13,331.92	0.12
371	600073	上海梅林	1,400	13,286.00	0.11
372	000586	汇源通信	1,400	13,258.00	0.11
373	603956	威派格	800	13,176.00	0.11
374	002301	齐心集团	800	13,136.00	0.11
375	600419	天润乳业	900	13,131.00	0.11
376	603969	银龙股份	3,000	13,050.00	0.11
377	600720	祁连山	800	13,000.00	0.11
378	300520	科大国创	700	12,943.00	0.11
379	002931	锋龙股份	800	12,936.00	0.11
380	300019	硅宝科技	1,100	12,925.00	0.11
381	600939	重庆建工	3,600	12,924.00	0.11
382	603214	爱婴室	420	12,881.40	0.11
383	603960	克来机电	460	12,843.20	0.11
384	000025	特力A	700	12,831.00	0.11
385	600337	美克家居	2,900	12,818.00	0.11
386	603718	海利生物	700	12,782.00	0.11
387	600855	航天长峰	800	12,720.00	0.11
388	002494	华斯股份	2,700	12,663.00	0.11
389	002041	登海种业	1,000	12,650.00	0.11
390	002380	科远智慧	900	12,600.00	0.11
391	002801	微光股份	300	12,585.00	0.11
392	300287	飞利信	3,000	12,450.00	0.11
393	300526	中潜股份	100	12,420.00	0.11
394	603936	博敏电子	840	12,406.80	0.11
395	000550	江铃汽车	1,000	12,370.00	0.11

396	000957	中通客车	1,900	12,369.00	0.11
397	002792	通宇通讯	500	12,290.00	0.11
398	000993	闽东电力	2,100	12,243.00	0.11
399	600285	羚锐制药	1,300	12,155.00	0.11
400	603901	永创智能	1,700	12,104.00	0.10
401	002788	鹭燕医药	1,400	12,096.00	0.10
402	300693	盛弘股份	600	12,012.00	0.10
403	002884	凌霄泵业	710	12,006.10	0.10
404	600727	鲁北化工	1,800	11,952.00	0.10
405	603020	爱普股份	1,200	11,904.00	0.10
406	600200	江苏吴中	1,800	11,826.00	0.10
407	603098	森特股份	1,300	11,739.00	0.10
408	000889	中嘉博创	1,300	11,661.00	0.10
409	000905	厦门港务	1,800	11,610.00	0.10
410	300653	正海生物	150	11,583.00	0.10
411	002291	星期六	500	11,550.00	0.10
412	600495	晋西车轴	3,000	11,520.00	0.10
413	603398	邦宝益智	1,300	11,479.00	0.10
414	002915	中欣氟材	600	11,466.00	0.10
415	603839	安正时尚	900	11,430.00	0.10
416	002599	盛通股份	2,900	11,426.00	0.10
417	600805	悦达投资	2,800	11,424.00	0.10
418	600078	澄星股份	2,700	11,394.00	0.10
419	600129	太极集团	800	11,312.00	0.10
420	002347	泰尔股份	2,700	11,259.00	0.10
421	000936	华西股份	900	11,250.00	0.10
422	002246	北化股份	1,500	11,220.00	0.10
423	300204	舒泰神	1,000	11,160.00	0.10
424	002878	元隆雅图	510	11,158.80	0.10
425	002922	伊戈尔	800	11,000.00	0.10
426	300422	博世科	1,000	10,970.00	0.09

427	300079	数码科技	2,300	10,925.00	0.09
428	002861	瀛通通讯	400	10,908.00	0.09
429	300393	中来股份	1,620	10,821.60	0.09
430	002342	巨力索具	3,700	10,804.00	0.09
431	601606	长城军工	800	10,784.00	0.09
432	300202	聚龙股份	1,000	10,750.00	0.09
433	300404	博济医药	650	10,549.50	0.09
434	600744	华银电力	4,700	10,481.00	0.09
435	000019	深粮控股	1,300	10,452.00	0.09
436	603558	健盛集团	1,200	10,344.00	0.09
437	002669	康达新材	700	10,339.00	0.09
438	300336	新文化	2,100	10,332.00	0.09
439	603393	新天然气	280	10,318.00	0.09
440	002205	国统股份	1,120	10,304.00	0.09
441	002036	联创电子	819	10,237.50	0.09
442	002097	山河智能	1,700	10,149.00	0.09
443	603600	永艺股份	900	10,143.00	0.09
444	300743	天地数码	600	10,134.00	0.09
445	300584	海辰药业	400	10,112.00	0.09
446	002416	爱施德	1,400	10,052.00	0.09
447	600261	阳光照明	2,800	9,940.00	0.09
448	300657	弘信电子	495	9,934.65	0.09
449	300731	科创新源	300	9,900.00	0.09
450	300232	洲明科技	1,216	9,837.44	0.09
451	000915	山大华特	300	9,825.00	0.08
452	000713	丰乐种业	1,000	9,810.00	0.08
453	002798	帝欧家居	300	9,741.00	0.08
454	002073	软控股份	2,500	9,725.00	0.08
455	300380	安硕信息	500	9,645.00	0.08
456	300740	御家汇	700	9,632.00	0.08
457	300155	安居宝	1,600	9,584.00	0.08

458	600662	强生控股	1,200	9,576.00	0.08
459	600461	洪城水业	1,500	9,555.00	0.08
460	002274	华昌化工	2,000	9,540.00	0.08
461	600866	星湖科技	2,100	9,534.00	0.08
462	603118	共进股份	800	9,512.00	0.08
463	002012	凯恩股份	1,700	9,418.00	0.08
464	603363	傲农生物	400	9,348.00	0.08
465	300096	易联众	1,100	9,317.00	0.08
466	002889	东方嘉盛	400	9,268.00	0.08
467	600479	千金药业	1,000	9,250.00	0.08
468	603998	方盛制药	1,400	9,226.00	0.08
469	603081	大丰实业	800	9,032.00	0.08
470	300047	天源迪科	1,242	9,016.92	0.08
471	002892	科力尔	400	9,012.00	0.08
472	000791	甘肃电投	2,900	8,961.00	0.08
473	002199	东晶电子	1,100	8,921.00	0.08
474	600229	城市传媒	1,200	8,904.00	0.08
475	002063	远光软件	700	8,841.00	0.08
476	002917	金奥博	900	8,811.00	0.08
477	300129	泰胜风能	2,400	8,808.00	0.08
478	002278	神开股份	1,700	8,806.00	0.08
479	603716	塞力斯	600	8,736.00	0.08
480	002054	德美化工	1,300	8,684.00	0.08
481	002724	海洋王	1,400	8,624.00	0.07
482	600210	紫江企业	2,000	8,580.00	0.07
483	603333	尚纬股份	1,300	8,489.00	0.07
484	002674	兴业科技	800	8,488.00	0.07
485	600458	时代新材	1,300	8,424.00	0.07
486	300446	乐凯新材	900	8,280.00	0.07
487	000756	新华制药	800	8,256.00	0.07
488	300046	台基股份	400	8,092.00	0.07

489	601858	中国科传	900	8,091.00	0.07
490	000677	恒天海龙	2,600	7,904.00	0.07
491	600107	美尔雅	1,100	7,788.00	0.07
492	300030	阳普医疗	800	7,736.00	0.07
493	002721	金一文化	2,000	7,560.00	0.07
494	300609	汇纳科技	200	7,340.00	0.06
495	603229	奥翔药业	140	7,280.00	0.06
496	601900	南方传媒	800	7,232.00	0.06
497	600127	金健米业	200	1,930.00	0.02
498	002305	南国置业	100	272.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	002031	巨轮智能	73,960.00	0.69
2	300235	方直科技	66,533.00	0.62
3	300659	中孚信息	66,088.00	0.62
4	000802	北京文化	65,264.00	0.61
5	600713	南京医药	64,227.00	0.60
6	600218	全柴动力	63,569.00	0.59
7	300692	中环环保	63,108.00	0.59
8	600382	广东明珠	62,653.00	0.58
9	002895	川恒股份	62,152.00	0.58
10	000913	钱江摩托	60,476.00	0.56
11	300453	三鑫医疗	59,570.00	0.56
12	603315	福鞍股份	58,188.00	0.54
13	000514	渝开发	58,178.00	0.54

14	600693	东百集团	57,253.00	0.53
15	300593	新雷能	56,906.00	0.53
16	603123	翠微股份	55,532.00	0.52
17	000042	中洲控股	54,545.00	0.51
18	603128	华贸物流	54,523.00	0.51
19	300417	南华仪器	54,196.00	0.51
20	002877	智能自控	53,667.00	0.50

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	603005	晶方科技	84,292.40	0.79
2	603456	九洲药业	77,964.00	0.73
3	603737	三棵树	66,459.00	0.62
4	300223	北京君正	59,905.00	0.56
5	600713	南京医药	58,950.00	0.55
6	300209	天泽信息	56,441.00	0.53
7	000973	佛塑科技	55,447.00	0.52
8	603609	禾丰牧业	55,204.00	0.52
9	002012	凯恩股份	54,180.00	0.51
10	300602	飞荣达	53,332.04	0.50
11	603345	安井食品	50,970.00	0.48
12	300414	中光防雷	50,629.00	0.47
13	002683	宏大爆破	50,551.00	0.47
14	002305	南国置业	49,475.00	0.46
15	300598	诚迈科技	46,159.00	0.43
16	000818	航锦科技	44,987.00	0.42
17	603036	如通股份	42,200.00	0.39
18	002568	百润股份	41,687.00	0.39

19	300457	赢合科技	41,325.00	0.39
20	600794	保税科技	39,069.00	0.36

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	11,944,689.22
卖出股票收入(成交)总额	12,424,845.73

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	230,345.00	1.99
	其中: 政策性金融债	230,345.00	1.99
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	230,345.00	1.99

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	2,300	230,345.00	1.99
---	--------	--------	-------	------------	------

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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	723.36
2	应收证券清算款	42,853.29
3	应收股利	-
4	应收利息	7,384.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,961.60

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 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	129	39,970.06	5,000,200.04	96.9 8%	155,937.46	3.02%

国证2000指数A						
创金合信国证2000指数C	166	34,092.65	5,000,200.00	88.35%	659,180.48	11.65%
合计	277	39,045.19	10,000,400.04	92.46%	815,117.94	7.54%

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	创金合信国证2000指数A	5,586.65	0.11%
	创金合信国证2000指数C	1,011.02	0.02%
	合计	6,597.67	0.06%

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	创金合信国证2000指数A	0~10
	创金合信国证2000指数C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信国证2000指数A	0
	创金合信国证2000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	10,000,400.04	92.46%	10,000,400.04	92.46%	36月
基金管理人高级管理人员	5,586.65	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	10,005,986.69	92.51%	10,000,400.04	92.46%	36月

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信国证2000指数 A	创金合信国证2000指数 C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	5,020,388.67	5,037,251.33
本报告期期初基金份额总额	5,424,427.08	5,743,286.37
本报告期基金总申购份额	461,241.98	2,974,603.56
减：本报告期基金总赎回份额	729,531.56	3,058,509.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	5, 156, 137. 50	5, 659, 380. 48
-------------	-----------------	-----------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2020年06月30日表决通过了《关于终止创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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	22,368,588.51	91.80%	7,119.19	91.73%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	20,028.00	0.08%	8.41	0.11%	-
中泰证券	2	1,895,539.34	7.78%	607.03	7.82%	-
中信建投证券	2	83,760.00	0.34%	26.48	0.34%	-

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	-	-	100,000.00	100.00%	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金2019年年度报告	公司官网、证券时报	2020-04-30
2	创金合信国证2000指数发起式证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、证券时报	2020-05-29
3	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告	公司官网、证券时报	2020-05-29
4	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证2000指数发起式证券	公司官网、证券时报	2020-05-30

	投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
5	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	公司官网、证券时报	2020-06-01

§ 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	10,000,400.04	0.00	0.00	10,000,400.04	92.46%
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、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国证2000指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国证2000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