

创金合信中证 1000 指数增强型发起式 证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了 2021 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12	投资组合报告附注	75
§9	基金份额持有人信息	76
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	77
§10	开放式基金份额变动	77
§11	重大事件揭示	78
11.1	基金份额持有人大会决议	78
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	78
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4	基金投资策略的改变	78
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8	其他重大事件	79
§12	影响投资者决策的其他重要信息	81
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	81
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	81
§13	备查文件目录	81
13.1	备查文件目录	82
13.2	存放地点	82
13.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证 1000 增强	
基金主代码	003646	
交易代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	127,426,489.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份 额总额	31,827,172.69 份	95,599,317.12 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限 公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838944
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfun d.com
		秦一楠
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-868-0666	95599
传真	0755-25832571	010-68121816
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518052	100031
法定代表人	钱龙海	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信中证 1000 增强 A

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	9,082,415.74	23,672,532.58	6,568,432.75
本期利润	11,606,849.23	20,461,292.94	9,077,173.65
加权平均基金份额本期利润	0.3911	0.3999	0.1937
本期加权平均净值利润率	24.70%	31.84%	20.63%
本期基金份额净值增长率	25.45%	38.57%	36.62%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	18,522,859.51	11,604,586.82	-5,739,002.28
期末可供分配基金份额利润	0.5820	0.2854	-0.1172
期末基金资产净值	56,273,458.30	57,314,963.03	49,794,046.13
期末基金份额净值	1.7681	1.4094	1.0171
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	76.81%	40.94%	1.71%

2、创金合信中证 1000 增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	19,341,947.83	18,168,751.27	9,443,486.94
本期利润	20,045,306.95	19,308,668.86	11,346,599.46
加权平均基金份额本期利润	0.3517	0.5137	0.1843
本期加权平均净值利润率	21.54%	44.62%	19.63%
本期基金份额净值增长率	25.20%	38.28%	35.76%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	53,760,488.34	1,735,202.57	-10,137,361.44
期末可供分配基金份额利润	0.5624	0.2719	-0.1247
期末基金资产净值	167,082,455.21	8,907,983.96	82,076,231.84
期末基金份额净值	1.7477	1.3959	1.0095
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	74.77%	39.59%	0.95%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证 1000 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.99%	1.06%	7.78%	1.00%	0.21%	0.06%
过去六个月	13.46%	1.18%	12.48%	1.19%	0.98%	-0.01%
过去一年	25.45%	1.13%	19.59%	1.15%	5.86%	-0.02%
过去三年	137.49%	1.39%	76.66%	1.44%	60.83%	-0.05%
过去五年	78.83%	1.33%	-4.44%	1.37%	83.27%	-0.04%
自基金合同生效起至今	76.81%	1.32%	-5.69%	1.37%	82.50%	-0.05%

创金合信中证 1000 增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.93%	1.06%	7.78%	1.00%	0.15%	0.06%
过去六个月	13.34%	1.18%	12.48%	1.19%	0.86%	-0.01%
过去一年	25.20%	1.13%	19.59%	1.15%	5.61%	-0.02%
过去三年	135.03%	1.39%	76.66%	1.44%	58.37%	-0.05%
过去五年	76.79%	1.32%	-4.44%	1.37%	81.23%	-0.05%
自基金合同生效起至今	74.77%	1.32%	-5.69%	1.37%	80.46%	-0.05%

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

创金合信中证1000增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月22日-2021年12月31日)



创金合信中证1000增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年12月22日-2021年12月31日)



3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，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。

创金合信基金成立于 2014 年 7 月，是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念，创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力，并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 12 月 31 日，创金合信基金共管理 79 只公募基金，公募管理规模 829 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		
孙悦	本基金基金经理	2021 年 7 月 9 日	-	4	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，2017 年 7 月加入创金合信基金管理有限公司，历任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
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 年 7 月 5 日	-	18	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(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理,负责美股量化模型开发及投资工作。2009 年 8 月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员,负责港股量化模型开发和投资,以及环球股指期货期权的量化投资。2011 年 1 月加入信达国际任执行董事、基金经理,进行港股投资。2012 年 8 月加入华安基金管理有限公司,任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015 年加入香港启智资产管理有限公司（Zentific Investment Management）任投资部基金经理。2017 年 9 月加入创金合信基金管理有限公司,现任首席量化投资官，兼量化指数与国际部总监、基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易与异常交易管理制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，合规与风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，全球仍然持续受到新冠疫情的影响，病毒的不断变异使经济复苏的不确定性增强。在通胀持续高企的背景下，美联储货币政策开始转向，正式开启了缩减购债，2022 年加息的预期大大增强。国内方面，经济下行压力较大，企业盈利增速边际放缓。政策方面，12 月份中央经济会议提出着力稳定宏观经济大盘，保持社会大局稳定，货币政策灵活适度，财政政策提升效能。大类资产方面，原油价格、美元指数大幅上涨，黄金窄幅区间震荡，美股、A 股震荡上行。

2021 年，中证 1000 指数震荡上行，行业间收益率分化比较明显。业绩基准指数成份股内，表现最好的几个行业是钢铁 102.63%、化工 59.37%、有色金属 44.61%，表现最差的几个行业是非银金融-18.29%、综合-10.55%、银行-7.09%。风格方面，成份股内盈利因子表现较好，动量因子表现较差。

本基金以中证 1000 指数为基准，管理人严格遵守指数增强的限制，坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格约束各个维度上的风险暴露，在有限范围内进行超配或低配，以控制跟踪误差，在此基础上追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证 1000 增强 A 基金份额净值为 1.7681 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 25.45%，同期业绩比较基准收益率为 19.59%；截至本报告期末创金合信中证 1000 增强 C 基金份额净值为 1.7477 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 25.20%，同期业绩比较基准收益率为 19.59%。

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 2022 年，中央经济会议给全年定下了基调，各项政策将围绕“稳增长”逐渐展开，货币政策、财政政策都有发力空间。在这样的背景下，A 股预计在风格和行业上更加均衡，仍然以结构性机会为主。首先在大小市值风格方面，2021 年大部分基本面好转的中小市值公司已经获得了资金关注，估值已经不便宜；而 2022 年中小市值整体的盈利增速相对大市

值没有明显优势。其次在行业方面，经过近 2 年的结构性行情后，部分高成长板块的估值已经偏高，盈利增速难以持续保持超预期，板块内部会有比较大的分化；低估值板块的估值处于历史底部，可能有困境反转的机会，部分行业有基本面好转的预期。因此，2022 年均衡配置、价值和成长并重的策略预计更加有效。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，严格履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。修订了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易与异常交易管理制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；

(9) 完善员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万万元的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—创金合信基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20590 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“创金合信中证 1000 增强基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了创金合信中证 1000 增强基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信中证 1000 增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	创金合信中证 1000 增强基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照

	<p>企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创金合信中证 1000 增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算创金合信中证 1000 增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督创金合信中证 1000 增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对创金合信中证 1000 增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致创金合信中证 1000 增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	郭素宏	李崇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 22 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,464,353.50	2,147,013.01
结算备付金		5,023,852.70	2,129,378.39
存出保证金		944,177.69	66,883.97
交易性金融资产	7.4.7.2	205,174,459.49	61,903,474.18
其中：股票投资		203,747,068.29	60,455,359.18
基金投资		-	-
债券投资		1,427,391.20	1,448,115.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		451,483.07	264,182.05
应收利息	7.4.7.5	26,947.23	16,008.42
应收股利		-	-
应收申购款		1,178,859.89	92,693.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		225,264,133.57	66,619,633.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		494,030.13	63,654.28

应付赎回款		532,659.20	69,425.96
应付管理人报酬		150,379.08	44,735.03
应付托管费		28,196.06	8,387.83
应付销售服务费		27,630.01	1,525.88
应付交易费用	7.4.7.7	478,989.78	68,623.86
应交税费		-	301.42
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	196,335.80	140,032.37
负债合计		1,908,220.06	396,686.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	127,426,489.81	47,047,380.56
未分配利润	7.4.7.10	95,929,423.70	19,175,566.43
所有者权益合计		223,355,913.51	66,222,946.99
负债和所有者权益总计		225,264,133.57	66,619,633.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，创金合信中证 1000 增强 A 份额净值 1.7681 元，基金份额总额 31,827,172.69 份；创金合信中证 1000 增强 C 份额净值 1.7477 元，基金份额总额 95,599,317.12 份；总份额合计 127,426,489.81 份。

7.2 利润表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		35,516,393.55	42,502,849.84
1.利息收入		127,299.12	142,994.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	97,366.08	68,328.60
债券利息收入		29,933.04	74,666.26
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,547,981.34	44,046,905.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,438,459.70	42,638,541.15
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	6,354.00	-27,743.25
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	526,281.05	619,533.98
股利收益	7.4.7.16	576,886.59	816,573.82
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,227,792.61	-2,071,322.05
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	613,320.48	384,271.33
减：二、费用		3,864,237.37	2,732,888.04
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,121,729.21	860,204.80
2.托管费	7.4.10.2.2	210,324.30	161,288.45
3.销售服务费	7.4.10.2.3	186,397.74	87,718.95
4.交易费用	7.4.7.19	2,114,700.65	1,453,517.16
5.利息支出		4,783.46	689.92
其中：卖出回购金融资产 支出		4,783.46	689.92
6.税金及附加		2,120.98	2,230.30
7.其他费用	7.4.7.20	224,181.03	167,238.46
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		31,652,156.18	39,769,961.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		31,652,156.18	39,769,961.80

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基 金净值）	47,047,380.56	19,175,566.43	66,222,946.99
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润）	-	31,652,156.18	31,652,156.18
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）	80,379,109.25	45,101,701.09	125,480,810.34

其中：1.基金申购款	308,977,341.48	188,256,924.93	497,234,266.41
2.基金赎回款	-228,598,232.23	-143,155,223.84	-371,753,456.07
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）	127,426,489.81	95,929,423.70	223,355,913.51
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	130,256,604.33	1,613,673.64	131,870,277.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,769,961.80	39,769,961.80
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）	-83,209,223.77	-22,208,069.01	-105,417,292.78
其中：1.基金申购款	126,113,017.09	20,921,037.31	147,034,054.40
2.基金赎回款	-209,322,240.86	-43,129,106.32	-252,451,347.18
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）	47,047,380.56	19,175,566.43	66,222,946.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____ ____奚胜田____ ____沈琼____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1918 号《关于准予创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,115,380.08 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1553 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，

《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,115,717.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 337.34 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表外以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表外以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占

基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能

够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	12,464,353.50	2,147,013.01
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	12,464,353.50	2,147,013.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	200,118,230.46	203,747,068.29	3,628,837.83	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,430,186.30	1,427,391.20	-2,795.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,430,186.30	1,427,391.20	-2,795.10
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	201,548,416.76	205,174,459.49	3,626,042.73	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	59,909,719.06	60,455,359.18	545,640.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,443,625.00	1,448,115.00	4,490.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,443,625.00	1,448,115.00	4,490.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	61,353,344.06	61,903,474.18	550,130.12
----	---------------	---------------	------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,750,360.00	-	-	-
--股指期货	5,750,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,750,360.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。报告期末本基金持有的股指期货合约情况详见“报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明”章节。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,111.58	555.86
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,359.04	985.00
应收债券利息	21,418.31	14,434.45

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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	58.30	33.11
合计	26,947.23	16,008.42

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	478,989.78	68,623.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	478,989.78	68,623.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	184.90	32.37
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	196,150.90	140,000.00
合计	196,335.80	140,032.37

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

创金合信中证 1000 增强 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	40,665,749.72	40,665,749.72
本期申购	72,641,410.60	72,641,410.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-81,479,987.63	-81,479,987.63
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	31,827,172.69	31,827,172.69

创金合信中证 1000 增强 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,381,630.84	6,381,630.84
本期申购	236,335,930.88	236,335,930.88

本期赎回（以“-”号填列）	-147,118,244.60	-147,118,244.60
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	95,599,317.12	95,599,317.12

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

创金合信中证 1000 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,604,586.82	5,044,626.49	16,649,213.31
本期利润	9,082,415.74	2,524,433.49	11,606,849.23
本期基金份额交易产生的变动数	-2,164,143.05	-1,645,633.88	-3,809,776.93
其中：基金申购款	30,490,844.09	12,638,749.29	43,129,593.38
基金赎回款	-32,654,987.14	-14,284,383.17	-46,939,370.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,522,859.51	5,923,426.10	24,446,285.61

创金合信中证 1000 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,735,202.57	791,150.55	2,526,353.12
本期利润	19,341,947.83	703,359.12	20,045,306.95
本期基金份额交易产生的变动数	32,683,337.94	16,228,140.08	48,911,478.02
其中：基金申购款	98,762,718.36	46,364,613.19	145,127,331.55
基金赎回款	-66,079,380.42	-30,136,473.11	-96,215,853.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,760,488.34	17,722,649.75	71,483,138.09

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	67,895.09	38,402.69
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	28,603.12	28,541.04
其他	867.87	1,384.87
合计	97,366.08	68,328.60

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	30,438,459.70	42,638,541.15
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	30,438,459.70	42,638,541.15

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,082,375,530.57	756,552,408.46
减：卖出股票成本总额	1,051,937,070.87	713,913,867.31
买卖股票差价收入	30,438,459.70	42,638,541.15

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,224,875.50	4,248,520.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,150,646.00	4,139,542.18
减：应收利息总额	67,875.50	136,721.51
买卖债券差价收入	6,354.00	-27,743.25

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
期货投资	526,281.05	619,533.98

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	576,886.59	816,573.82
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	576,886.59	816,573.82

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	3,075,912.61	-2,058,282.05
——股票投资	3,083,197.71	-2,063,743.23
——债券投资	-7,285.10	5,461.18
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	151,880.00	-13,040.00
——权证投资	-	-
——期货投资	151,880.00	-13,040.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,227,792.61	-2,071,322.05

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	607,081.24	383,183.71
转换费收入	6,239.24	1,087.62
合计	613,320.48	384,271.33

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,110,790.29	1,452,315.77
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货市场交易费用	3,910.36	1,201.39
合计	2,114,700.65	1,453,517.16

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	8,030.13	7,238.46
指数使用费	41,150.90	40,000.00
合计	224,181.03	167,238.46

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,573,636,367.67	69.41%	1,212,474,659.31	86.36%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	443,265.70	14.71%	742,508.10	33.94%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	600,000.00	5.66%	1,000,000.00	30.30%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	659,931.71	81.46%	478,989.78	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	510,868.85	92.51%	27,239.45	39.69%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,121,729.21	860,204.80
其中：支付销售机构的客户维护费	378,984.20	175,233.63

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	210,324.30	161,288.45

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	45,086.61	45,086.61
第一创业证券	-	562.68	562.68
合计	-	45,649.29	45,649.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C	合计
创金合信直销	-	60,139.73	60,139.73
第一创业证券	-	14.20	14.20
合计	-	60,153.93	60,153.93

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
报告期初持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.66
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	5,000,166.70	5,000,166.66
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	12,464,353.50	67,895.09	2,147,013.01	38,402.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688091	上海谊众	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	科创板打新限售	38.10	42.81	1,943	74,028.30	83,179.83	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	1,642	68,931.16	68,931.16	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	6,454	67,896.08	67,896.08	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	创业板打新限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	创业板打新限售	116.88	116.08	198	23,142.24	22,983.84	-
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	创业板打新限售	60.66	96.75	217	13,163.22	20,994.75	-
301082	久盛电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	创业板打新限售	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	创业板打新限售	10.07	16.76	1,148	11,560.36	19,240.48	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	创业板打新限售	60.64	234.74	80	4,851.20	18,779.20	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	创业板打新限售	25.80	33.65	547	14,112.60	18,406.55	-
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	创业板打新限售	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301118	恒光股份	2021 年	2022 年	创业板	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-

		11 月 9 日	5 月 18 日	打新限售						
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	创业板打新限售	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	创业板打新限售	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	创业板打新限售	69.89	88.72	164	11,461.96	14,550.08	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	创业板打新限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	创业板打新限售	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	创业板打新限售	10.45	11.22	1,168	12,205.60	13,104.96	-
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	创业板打新限售	12.03	17.12	727	8,745.81	12,446.24	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	创业板打新限售	27.81	31.14	393	10,929.33	12,238.02	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	创业板打新限售	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	创业板打新限售	39.08	52.13	224	8,753.92	11,677.12	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	创业板打新限售	36.50	31.31	350	12,775.00	10,958.50	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	创业板打新限售	29.28	32.00	318	9,311.04	10,176.00	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	创业板打新限售	58.08	49.85	201	11,674.08	10,019.85	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	创业板打新限售	4.13	12.96	771	3,184.23	9,992.16	-

301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	创业板 打新限 售	86.06	94.50	102	8,778.12	9,639.00	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	创业板 打新限 售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	创业板 打新限 售	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	创业板 打新限 售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	创业板 打新限 售	30.73	29.14	294	9,034.62	8,567.16	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 3 月 1 日	创业板 打新限 售	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	创业板 打新限 售	27.85	27.46	304	8,466.40	8,347.84	-
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	创业板 打新限 售	79.60	78.53	102	8,119.20	8,010.06	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	创业板 打新限 售	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	创业板 打新限 售	36.31	35.52	221	8,024.51	7,849.92	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	创业板 打新限 售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	创业板 打新限 售	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	创业板 打新限 售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	创业板 打新限 售	57.27	53.71	140	8,017.80	7,519.40	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1	2022 年 6 月 8	创业板 打新限	43.99	50.77	131	5,762.69	6,650.87	-

		日	日	售						
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	创业板 打新限 售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	创业板 打新限 售	19.34	32.92	188	3,635.92	6,188.96	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	创业板 打新限 售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	创业板 打新限 售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	创业板 打新限 售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	创业板 打新限 售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未 上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	创业板 打新限 售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	创业板 打新限 售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	创业板 打新限 售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	创业板 打新限 售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	创业板 打新限 售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 27 日	2022 年 1 月 14 日	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	1,230	123,000.00	123,000.00	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,304,391.20	1,448,115.00
合计	1,304,391.20	1,448,115.00

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	123,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	123,000.00	-

未评级债券包括国债、政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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%。

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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	12,464,353.50	-	-	-	12,464,353.50
结算备付金	5,023,852.70	-	-	-	5,023,852.70
存出保证金	944,177.69	-	-	-	944,177.69
交易性金融资产	1,304,391.20	-	123,000.00	203,747,068.29	205,174,459.49
应收利息	-	-	-	26,947.23	26,947.23
应收申购款	-	-	-	1,178,859.89	1,178,859.89
应收证券清算款	-	-	-	451,483.07	451,483.07
资产总计	19,736,775.09	-	123,000.00	205,404,358.48	225,264,133.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	532,659.20	532,659.20
应付管理人报酬	-	-	-	150,379.08	150,379.08
应付托管费	-	-	-	28,196.06	28,196.06
应付销售服务费	-	-	-	27,630.01	27,630.01
应付交易费用	-	-	-	478,989.78	478,989.78
应付证券清算款	-	-	-	494,030.13	494,030.13
其他负债	-	-	-	196,335.80	196,335.80
负债总计	-	-	-	1,908,220.06	1,908,220.06

利率敏感度缺口	19,736,775.09	-	123,000.00	203,496,138.42	223,355,913.51
上年度末 2020 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	2,147,013.01	-	-	-	2,147,013.01
结算备付金	2,129,378.39	-	-	-	2,129,378.39
存出保证金	66,883.97	-	-	-	66,883.97
交易性金融资产	1,448,115.00	-	-	60,455,359.18	61,903,474.18
应收证券清算款	-	-	-	264,182.05	264,182.05
应收利息	-	-	-	16,008.42	16,008.42
应收申购款	-	-	-	92,693.60	92,693.60
资产总计	5,791,390.37	-	-	60,828,243.25	66,619,633.62
负债					
应付证券清算款	-	-	-	63,654.28	63,654.28
应付赎回款	-	-	-	69,425.96	69,425.96
应付管理人报酬	-	-	-	44,735.03	44,735.03
应付托管费	-	-	-	8,387.83	8,387.83
应付销售服务费	-	-	-	1,525.88	1,525.88
应付交易费用	-	-	-	68,623.86	68,623.86
应交税费	-	-	-	301.42	301.42
其他负债	-	-	-	140,032.37	140,032.37
负债总计	-	-	-	396,686.63	396,686.63
利率敏感度缺口	5,791,390.37	-	-	60,431,556.62	66,222,946.99

注：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。

7.4.13.4.1.2 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升相关风险变量的变动 25 个基点	-996.27	-1,926.07
2.市场利率平行下降相关风险变量的变动 25 个基点	999.47	1,933.33	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	203,747,068.29	91.22	60,455,359.18	91.29
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	203,747,068.29	91.22	60,455,359.18	91.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	9,626,030.24	3,029,139.55
2.业绩比较基准下降 5%	-9,626,030.24	-3,029,139.55	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 202,990,531.29 元，属于第二层次的余额为 2,183,928.20 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 58,213,956.12 元，属于第二层次的余额为 3,689,518.06 元，无属于第三层次的余额)。

(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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 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。

7.4.14.2

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至

2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	203,747,068.29	90.45
	其中：股票	203,747,068.29	90.45
2	固定收益投资	1,427,391.20	0.63
	其中：债券	1,427,391.20	0.63
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,488,206.20	7.76
7	其他资产	2,601,467.88	1.15
8	合计	225,264,133.57	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,463,936.00	2.89
C	制造业	131,222,856.84	58.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,931,780.00	1.76
E	建筑业	1,484,112.00	0.66
F	批发和零售业	6,690,928.00	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,055,193.00	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,830,246.51	7.09
J	金融业	2,919,241.66	1.31
K	房地产业	2,862,626.00	1.28
L	租赁和商务服务业	2,011,597.50	0.90
M	科学研究和技术服务业	4,187,231.01	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	1,548,393.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	251,504.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	193,592.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	180,653,237.52	80.88

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,137,040.00	0.51
C	制造业	14,566,432.92	6.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	232,248.20	0.10
F	批发和零售业	768,495.68	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	7,628.16	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,752.59	0.06
J	金融业	3,079,628.72	1.38
K	房地产业	1,760,748.00	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	101,071.74	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	890,699.81	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	387,090.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	37,994.95	0.02
S	综合	-	-
	合计	23,093,830.77	10.34

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 报告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	300073	当升科技	28,200	2,449,734.00	1.10
2	300769	德方纳米	4,900	2,406,684.00	1.08
3	300568	星源材质	64,176	2,357,184.48	1.06
4	600456	宝钛股份	31,500	2,261,070.00	1.01
5	002245	蔚蓝锂芯	82,100	2,258,571.00	1.01
6	300390	天华超净	27,452	2,223,612.00	1.00
7	300604	长川科技	38,240	2,198,800.00	0.98
8	002436	兴森科技	155,338	2,174,732.00	0.97
9	002139	拓邦股份	112,200	2,097,018.00	0.94
10	002597	金禾实业	40,600	2,084,810.00	0.93
11	300395	菲利华	31,700	2,083,958.00	0.93
12	300327	中颖电子	30,520	2,072,308.00	0.93
13	002389	航天彩虹	72,900	2,026,620.00	0.91
14	300398	飞凯材料	82,300	1,988,368.00	0.89
15	002643	万润股份	83,600	1,976,304.00	0.88
16	688122	西部超导	20,362	1,973,892.28	0.88
17	688388	嘉元科技	15,692	1,970,130.60	0.88
18	300034	钢研高纳	34,200	1,969,920.00	0.88
19	300373	扬杰科技	29,100	1,954,938.00	0.88
20	300748	金力永磁	42,728	1,918,059.92	0.86
21	300638	广和通	34,600	1,885,700.00	0.84
22	300054	鼎龙股份	77,000	1,874,180.00	0.84
23	600499	科达制造	74,100	1,839,162.00	0.82
24	300319	麦捷科技	119,400	1,826,820.00	0.82
25	300662	科锐国际	29,350	1,825,863.50	0.82
26	002544	杰赛科技	76,900	1,825,606.00	0.82
27	603429	集友股份	68,700	1,793,070.00	0.80
28	002850	科达利	11,100	1,779,774.00	0.80
29	002585	双星新材	64,900	1,757,492.00	0.79
30	002859	洁美科技	46,788	1,740,513.60	0.78
31	600682	南京新百	146,800	1,726,368.00	0.77
32	000968	蓝焰控股	183,000	1,711,050.00	0.77
33	300470	中密控股	37,500	1,675,125.00	0.75
34	600059	古越龙山	136,200	1,665,726.00	0.75
35	600123	兰花科创	177,700	1,665,049.00	0.75

36	300755	华致酒行	32,400	1,622,592.00	0.73
37	300800	力合科技	55,700	1,614,186.00	0.72
38	600073	上海梅林	199,200	1,611,528.00	0.72
39	601311	骆驼股份	105,070	1,610,723.10	0.72
40	002929	润建股份	44,500	1,608,230.00	0.72
41	603108	润达医疗	119,900	1,607,859.00	0.72
42	603093	南华期货	118,200	1,605,156.00	0.72
43	002625	光启技术	66,400	1,594,264.00	0.71
44	300726	宏达电子	15,900	1,590,954.00	0.71
45	688030	山石网科	51,702	1,533,481.32	0.69
46	603678	火炬电子	20,000	1,513,000.00	0.68
47	300861	美畅股份	19,300	1,500,961.00	0.67
48	688050	爱博医疗	7,030	1,477,916.90	0.66
49	300573	兴齐眼药	10,500	1,436,400.00	0.64
50	600882	妙可蓝多	25,500	1,428,000.00	0.64
51	300696	爱乐达	27,240	1,414,845.60	0.63
52	600877	声光电科	90,300	1,414,098.00	0.63
53	300653	正海生物	21,000	1,402,170.00	0.63
54	600007	中国国贸	95,500	1,375,200.00	0.62
55	600850	电科数字	40,200	1,372,026.00	0.61
56	002738	中矿资源	19,500	1,372,020.00	0.61
57	600596	新安股份	53,400	1,334,466.00	0.60
58	000544	中原环保	207,700	1,329,280.00	0.60
59	002034	旺能环境	75,500	1,303,885.00	0.58
60	300012	华测检测	47,300	1,270,951.00	0.57
61	688222	成都先导	53,024	1,245,533.76	0.56
62	603733	仙鹤股份	30,300	1,236,543.00	0.55
63	601965	中国汽研	64,571	1,201,666.31	0.54
64	002240	盛新锂能	20,700	1,199,565.00	0.54
65	300672	国科微	6,400	1,187,200.00	0.53
66	688516	奥特维	4,829	1,186,581.88	0.53
67	300633	开立医疗	37,100	1,184,603.00	0.53
68	002254	泰和新材	56,900	1,115,809.00	0.50
69	000902	新洋丰	65,500	1,106,295.00	0.50
70	002402	和而泰	39,600	1,086,228.00	0.49
71	688139	海尔生物	11,871	1,078,124.22	0.48
72	002192	融捷股份	8,200	1,067,230.00	0.48
73	300775	三角防务	21,300	1,041,357.00	0.47
74	300171	东富龙	20,500	1,036,070.00	0.46
75	600116	三峡水利	88,400	1,030,744.00	0.46
76	688158	优刻得	38,435	1,019,296.20	0.46
77	688023	安恒信息	3,979	997,694.46	0.45
78	002042	华孚时尚	217,900	995,803.00	0.45

79	002833	弘亚数控	30,800	991,144.00	0.44
80	600452	涪陵电力	49,100	988,874.00	0.44
81	000762	西藏矿业	18,600	988,218.00	0.44
82	688278	特宝生物	32,443	949,931.04	0.43
83	002961	瑞达期货	37,900	933,856.00	0.42
84	600267	海正药业	66,500	930,335.00	0.42
85	603520	司太立	14,189	922,285.00	0.41
86	300369	绿盟科技	57,600	913,536.00	0.41
87	300036	超图软件	30,200	907,510.00	0.41
88	002913	奥士康	11,000	862,620.00	0.39
89	300659	中孚信息	18,900	857,115.00	0.38
90	002206	海利得	96,100	853,368.00	0.38
91	601567	三星医疗	52,200	851,382.00	0.38
92	002158	汉钟精机	31,000	825,530.00	0.37
93	300451	创业慧康	73,000	816,140.00	0.37
94	603959	百利科技	51,600	813,216.00	0.36
95	002145	中核钛白	62,100	781,839.00	0.35
96	300850	新强联	4,231	755,275.81	0.34
97	300118	东方日升	22,800	740,316.00	0.33
98	300409	道氏技术	29,900	725,075.00	0.32
99	002960	青鸟消防	14,600	708,830.00	0.32
100	688116	天奈科技	4,748	708,828.92	0.32
101	002880	卫光生物	21,980	707,316.40	0.32
102	688016	心脉医疗	2,788	693,487.12	0.31
103	600422	昆药集团	62,200	687,310.00	0.31
104	600711	盛屯矿业	61,300	657,749.00	0.29
105	605136	丽人丽妆	26,700	650,145.00	0.29
106	000818	航锦科技	17,500	649,425.00	0.29
107	300747	锐科激光	10,943	646,840.73	0.29
108	002106	莱宝高科	55,700	641,107.00	0.29
109	600694	大商股份	32,600	636,026.00	0.28
110	600246	万通发展	57,800	616,148.00	0.28
111	688598	金博股份	1,716	609,248.64	0.27
112	300236	上海新阳	14,700	600,495.00	0.27
113	300725	药石科技	4,160	591,427.20	0.26
114	300294	博雅生物	15,400	590,590.00	0.26
115	601126	四方股份	28,200	589,380.00	0.26
116	600360	华微电子	62,800	570,224.00	0.26
117	600510	黑牡丹	75,100	561,748.00	0.25
118	300379	东方通	18,700	552,211.00	0.25
119	002326	永太科技	10,500	537,705.00	0.24
120	603026	石大胜华	2,700	534,573.00	0.24
121	300777	中简科技	7,900	488,852.00	0.22

122	603039	泛微网络	6,900	481,413.00	0.22
123	688202	美迪西	966	469,079.94	0.21
124	603005	晶方科技	8,500	468,265.00	0.21
125	002222	福晶科技	24,500	463,785.00	0.21
126	603566	普莱柯	20,600	455,260.00	0.20
127	000915	华特达因	14,500	441,670.00	0.20
128	600894	广日股份	58,500	441,090.00	0.20
129	300679	电连技术	8,200	430,500.00	0.19
130	300378	鼎捷软件	16,900	405,600.00	0.18
131	300263	隆华科技	39,300	400,860.00	0.18
132	600590	泰豪科技	47,200	390,344.00	0.17
133	605111	新洁能	2,100	374,010.00	0.17
134	603508	思维列控	15,900	365,382.00	0.16
135	688788	科思科技	2,650	362,255.00	0.16
136	000950	重药控股	70,700	360,570.00	0.16
137	600363	联创光电	10,800	335,232.00	0.15
138	603688	石英股份	5,300	334,483.00	0.15
139	603128	华贸物流	23,700	324,216.00	0.15
140	002497	雅化集团	11,100	318,126.00	0.14
141	688166	博瑞医药	8,633	316,917.43	0.14
142	300723	一品红	8,800	315,920.00	0.14
143	688200	华峰测控	603	308,675.70	0.14
144	600846	同济科技	37,700	307,632.00	0.14
145	601208	东材科技	17,500	303,625.00	0.14
146	688408	中信博	1,716	302,891.16	0.14
147	603599	广信股份	7,700	300,300.00	0.13
148	000917	电广传媒	43,800	296,088.00	0.13
149	300226	上海钢联	7,200	292,680.00	0.13
150	002063	远光软件	29,100	289,254.00	0.13
151	002126	银轮股份	22,100	277,576.00	0.12
152	300900	广联航空	8,000	274,800.00	0.12
153	601666	平煤股份	32,400	271,188.00	0.12
154	600761	安徽合力	20,300	253,953.00	0.11
155	002984	森麒麟	7,100	252,547.00	0.11
156	600874	创业环保	35,700	252,399.00	0.11
157	600997	开滦股份	34,800	247,776.00	0.11
158	603713	密尔克卫	1,800	242,604.00	0.11
159	000657	中钨高新	14,900	239,592.00	0.11
160	300352	北信源	38,700	236,070.00	0.11
161	002792	通宇通讯	14,700	235,200.00	0.11
162	603565	中谷物流	7,900	224,281.00	0.10
163	000989	九芝堂	20,500	222,630.00	0.10
164	688020	方邦股份	2,380	216,937.00	0.10

165	300799	左江科技	2,300	216,200.00	0.10
166	300684	中石科技	9,600	210,624.00	0.09
167	300770	新媒股份	3,500	210,000.00	0.09
168	002135	东南网架	17,300	199,988.00	0.09
169	300497	富祥药业	12,100	197,593.00	0.09
170	000969	安泰科技	17,800	190,638.00	0.09
171	002456	欧菲光	19,400	188,180.00	0.08
172	603323	苏农银行	38,500	187,495.00	0.08
173	002324	普利特	13,000	183,560.00	0.08
174	600612	老凤祥	4,000	183,400.00	0.08
175	002276	万马股份	19,900	179,299.00	0.08
176	300143	盈康生命	12,500	176,500.00	0.08
177	603393	新天然气	7,000	172,410.00	0.08
178	300502	新易盛	4,400	172,392.00	0.08
179	688066	航天宏图	2,360	171,572.00	0.08
180	600491	龙元建设	23,900	164,671.00	0.07
181	002344	海宁皮城	33,400	163,660.00	0.07
182	002567	唐人神	21,900	163,593.00	0.07
183	603915	国茂股份	3,900	151,710.00	0.07
184	000560	我爱我家	46,000	144,440.00	0.06
185	000567	海德股份	8,000	142,800.00	0.06
186	688586	江航装备	4,165	141,193.50	0.06
187	688007	光峰科技	4,084	140,285.40	0.06
188	000582	北部湾港	17,400	139,896.00	0.06
189	002258	利尔化学	4,100	138,293.00	0.06
190	603489	八方股份	600	135,360.00	0.06
191	603118	共进股份	14,000	133,840.00	0.06
192	000828	东莞控股	12,200	124,196.00	0.06
193	000913	钱江摩托	8,600	122,034.00	0.05
194	002061	浙江交科	21,300	118,854.00	0.05
195	002756	永兴材料	800	118,416.00	0.05
196	000667	美好置业	67,800	117,972.00	0.05
197	300183	东软载波	6,400	116,672.00	0.05
198	603636	南威软件	13,000	116,220.00	0.05
199	002651	利君股份	8,700	115,101.00	0.05
200	002243	力合科创	10,100	114,029.00	0.05
201	300455	康拓红外	9,900	107,613.00	0.05
202	300596	利安隆	2,400	107,424.00	0.05
203	300627	华测导航	2,300	105,800.00	0.05
204	300664	鹏鹞环保	15,400	104,720.00	0.05
205	000688	国城矿业	7,400	103,452.00	0.05
206	603595	东尼电子	2,800	103,404.00	0.05
207	002204	大连重工	23,700	103,095.00	0.05

208	603212	赛伍技术	3,300	102,729.00	0.05
209	601827	三峰环境	11,100	99,012.00	0.04
210	688095	福昕软件	711	98,125.11	0.04
211	600825	新华传媒	20,600	97,232.00	0.04
212	300523	辰安科技	4,300	95,030.00	0.04
213	300579	数字认证	2,300	93,150.00	0.04
214	600812	华北制药	7,800	92,976.00	0.04
215	002277	友阿股份	26,800	87,368.00	0.04
216	603337	杰克股份	3,700	86,765.00	0.04
217	688127	蓝特光学	3,736	85,890.64	0.04
218	600635	大众公用	22,100	83,759.00	0.04
219	300302	同有科技	8,100	83,349.00	0.04
220	300229	拓尔思	7,900	81,765.00	0.04
221	002562	兄弟科技	16,100	80,339.00	0.04
222	601886	江河集团	12,100	79,739.00	0.04
223	002020	京新药业	8,100	77,031.00	0.03
224	000516	国际医学	6,800	75,004.00	0.03
225	000600	建投能源	14,600	74,314.00	0.03
226	603283	赛腾股份	2,400	70,560.00	0.03
227	002991	甘源食品	900	68,670.00	0.03
228	300457	赢合科技	2,200	67,584.00	0.03
229	300785	值得买	900	64,566.00	0.03
230	600873	梅花生物	8,100	62,127.00	0.03
231	601858	中国科传	6,500	57,330.00	0.03
232	002531	天顺风能	2,600	50,414.00	0.02
233	000627	天茂集团	15,086	49,934.66	0.02
234	688019	安集科技	177	48,356.40	0.02
235	688365	光云科技	3,347	46,389.42	0.02
236	000797	中国武夷	15,000	39,150.00	0.02
237	688018	乐鑫科技	175	33,257.00	0.01
238	300322	硕贝德	2,300	31,924.00	0.01
239	603103	横店影视	2,400	31,704.00	0.01
240	600151	航天机电	2,100	29,085.00	0.01
241	300855	图南股份	400	28,196.00	0.01
242	600688	上海石化	6,200	25,854.00	0.01
243	300439	美康生物	1,200	25,572.00	0.01
244	600323	瀚蓝环境	1,200	25,176.00	0.01
245	600057	厦门象屿	2,600	22,074.00	0.01
246	605118	力鼎光电	1,200	19,920.00	0.01
247	300266	兴源环境	4,000	15,600.00	0.01
248	000918	嘉凯城	3,200	7,968.00	0.00
249	600715	文投控股	2,200	7,326.00	0.00
250	688366	昊海生科	53	6,672.17	0.00

251	300709	精研科技	100	5,995.00	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688189	南新制药	43,849	1,544,361.78	0.69
2	000568	泸州老窖	6,000	1,523,220.00	0.68
3	002142	宁波银行	39,649	1,517,763.72	0.68
4	600031	三一重工	66,300	1,511,640.00	0.68
5	002968	新大正	42,000	1,488,060.00	0.67
6	000887	中鼎股份	52,400	1,142,844.00	0.51
7	601225	陕西煤业	93,200	1,137,040.00	0.51
8	601166	兴业银行	52,600	1,001,504.00	0.45
9	688178	万德斯	35,766	862,675.92	0.39
10	603722	阿科力	14,100	760,272.00	0.34
11	603829	洛凯股份	60,900	738,717.00	0.33
12	603716	塞力医疗	50,500	726,695.00	0.33
13	002028	思源电气	14,700	723,387.00	0.32
14	605288	凯迪股份	11,020	711,341.00	0.32
15	300174	元力股份	40,500	686,475.00	0.31
16	300059	东方财富	15,100	560,361.00	0.25
17	600580	卧龙电驱	30,500	557,845.00	0.25
18	002576	通达动力	32,700	542,820.00	0.24
19	300680	隆盛科技	16,400	511,680.00	0.23
20	300750	宁德时代	800	470,400.00	0.21
21	002919	名臣健康	10,500	413,595.00	0.19
22	600455	博通股份	17,000	387,090.00	0.17
23	600585	海螺水泥	8,200	330,460.00	0.15
24	000002	万科A	13,800	272,688.00	0.12
25	300450	先导智能	3,600	267,732.00	0.12
26	601339	百隆东方	41,900	246,791.00	0.11
27	002765	蓝黛科技	27,800	233,520.00	0.10
28	002976	瑞玛精密	10,300	228,145.00	0.10
29	603316	诚邦股份	41,220	227,534.40	0.10
30	300415	伊之密	9,700	206,028.00	0.09
31	688167	炬光科技	748	163,812.00	0.07
32	688096	京源环保	10,253	148,053.32	0.07
33	000988	华工科技	4,600	128,156.00	0.06
34	002829	星网宇达	3,100	122,233.00	0.05
35	300491	通合科技	4,500	88,650.00	0.04
36	688091	上海谊众	1,943	83,179.83	0.04

37	688262	国芯科技	1,642	68,931.16	0.03
38	301136	招标股份	6,454	67,896.08	0.03
39	000960	锡业股份	3,200	62,496.00	0.03
40	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
41	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
42	301050	雷电微力	98	23,167.78	0.01
43	301177	迪阿股份	198	22,983.84	0.01
44	300518	盛讯达	500	22,390.00	0.01
45	301155	海力风电	217	20,994.75	0.01
46	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
47	301149	隆华新材	1,148	19,240.48	0.01
48	301211	亨迪药业	547	18,406.55	0.01
49	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
50	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.01
51	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
52	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
53	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
54	301221	光庭信息	164	14,550.08	0.01
55	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
56	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
57	301090	华润材料	1,168	13,104.96	0.01
58	301127	C 天源	727	12,446.24	0.01
59	301100	风光股份	393	12,238.02	0.01
60	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
61	301168	通灵股份	224	11,677.12	0.01
62	301091	深城交	350	10,958.50	0.00
63	301199	迈赫股份	318	10,176.00	0.00
64	301093	华兰股份	201	10,019.85	0.00
65	301048	金鹰重工	771	9,992.16	0.00
66	301193	家联科技	337	9,936.71	0.00
67	301166	C 优宁维	102	9,639.00	0.00
68	301049	超越科技	280	9,366.64	0.00
69	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
70	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
71	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
72	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
73	301190	善水科技	304	8,347.84	0.00
74	301063	海锅股份	224	8,308.03	0.00
75	301096	百诚医药	102	8,010.06	0.00
76	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
77	301092	争光股份	221	7,849.92	0.00
78	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
79	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00

80	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
81	301073	君亭酒店	232	7,628.16	0.00
82	301108	洁雅股份	140	7,519.40	0.00
83	301072	中捷精工	202	6,846.26	0.00
84	301179	泽宇智能	131	6,650.87	0.00
85	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
86	300854	中兰环保	226	6,211.01	0.00
87	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
88	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
89	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
90	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
91	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
92	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
93	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603613	国联股份	8,642,813.15	13.05
2	002850	科达利	7,633,910.00	11.53
3	300012	华测检测	7,321,567.15	11.06
4	600123	兰花科创	7,313,856.00	11.04
5	300496	中科创达	7,282,339.30	11.00
6	002756	永兴材料	7,016,392.82	10.60
7	300327	中颖电子	6,963,687.42	10.52
8	002430	杭氧股份	6,712,314.00	10.14
9	300395	菲利华	6,556,495.00	9.90
10	002407	多氟多	6,497,999.00	9.81
11	300073	当升科技	6,072,117.00	9.17
12	300755	华致酒行	6,051,690.40	9.14
13	300390	天华超净	5,904,144.00	8.92
14	300726	宏达电子	5,900,166.00	8.91
15	300696	爱乐达	5,872,753.40	8.87
16	002258	利尔化学	5,857,185.00	8.84
17	603678	火炬电子	5,820,896.00	8.79
18	002245	蔚蓝锂芯	5,775,389.00	8.72
19	600456	宝钛股份	5,759,035.13	8.70
20	688005	容百科技	5,674,077.30	8.57
21	300568	星源材质	5,581,326.00	8.43
22	603267	鸿远电子	5,559,334.00	8.39

23	000933	神火股份	5,547,221.85	8.38
24	603026	石大胜华	5,480,360.80	8.28
25	300363	博腾股份	5,460,781.00	8.25
26	002585	双星新材	5,384,755.00	8.13
27	601898	中煤能源	5,381,705.00	8.13
28	300748	金力永磁	5,330,077.00	8.05
29	300470	中密控股	5,185,497.00	7.83
30	300633	开立医疗	5,134,500.00	7.75
31	300604	长川科技	5,083,188.80	7.68
32	002013	中航机电	4,958,936.00	7.49
33	000799	酒鬼酒	4,932,752.00	7.45
34	300672	国科微	4,889,527.00	7.38
35	603456	九洲药业	4,856,666.96	7.33
36	002568	百润股份	4,790,751.58	7.23
37	603008	喜临门	4,747,632.00	7.17
38	601636	旗滨集团	4,747,556.00	7.17
39	002402	和而泰	4,705,611.00	7.11
40	600882	妙可蓝多	4,627,615.00	6.99
41	000733	振华科技	4,593,738.00	6.94
42	300725	药石科技	4,548,831.20	6.87
43	002254	泰和新材	4,548,364.00	6.87
44	300171	东富龙	4,535,013.00	6.85
45	688388	嘉元科技	4,497,406.42	6.79
46	300724	捷佳伟创	4,452,145.00	6.72
47	603599	广信股份	4,429,233.00	6.69
48	603127	昭衍新药	4,411,019.80	6.66
49	600596	新安股份	4,394,954.00	6.64
50	300638	广和通	4,365,500.00	6.59
51	300685	艾德生物	4,262,736.00	6.44
52	002190	成飞集成	4,250,370.00	6.42
53	002597	金禾实业	4,250,152.28	6.42
54	000683	远兴能源	4,233,122.00	6.39
55	300662	科锐国际	4,204,847.66	6.35
56	300751	迈为股份	4,202,621.00	6.35
57	300059	东方财富	4,179,587.00	6.31
58	600031	三一重工	4,128,240.00	6.23
59	603733	仙鹤股份	4,125,871.00	6.23
60	688122	西部超导	4,076,420.57	6.16
61	002322	理工环科	4,035,876.79	6.09
62	300573	兴齐眼药	4,026,377.00	6.08
63	600110	诺德股份	4,023,585.30	6.08
64	000818	航锦科技	4,019,655.15	6.07
65	002409	雅克科技	4,006,253.00	6.05

66	002539	云图控股	3,986,810.14	6.02
67	002920	德赛西威	3,898,526.00	5.89
68	002034	旺能环境	3,869,397.00	5.84
69	300458	全志科技	3,851,271.00	5.82
70	002158	汉钟精机	3,817,344.56	5.76
71	300653	正海生物	3,807,995.00	5.75
72	601677	明泰铝业	3,795,138.00	5.73
73	002240	盛新锂能	3,787,840.00	5.72
74	002709	天赐材料	3,782,246.30	5.71
75	300034	钢研高纳	3,772,292.00	5.70
76	002833	弘亚数控	3,751,850.00	5.67
77	688116	天奈科技	3,726,110.21	5.63
78	603180	金牌厨柜	3,716,440.35	5.61
79	688158	优刻得	3,715,674.97	5.61
80	603128	华贸物流	3,632,777.00	5.49
81	000968	蓝焰控股	3,626,016.00	5.48
82	688188	柏楚电子	3,601,914.84	5.44
83	300596	利安隆	3,591,979.00	5.42
84	002544	杰赛科技	3,576,067.00	5.40
85	300659	中孚信息	3,537,462.00	5.34
86	601311	骆驼股份	3,527,359.67	5.33
87	300439	美康生物	3,514,891.00	5.31
88	688016	心脉医疗	3,499,328.84	5.28
89	300373	扬杰科技	3,461,878.00	5.23
90	000902	新洋丰	3,457,311.00	5.22
91	688100	威胜信息	3,449,961.03	5.21
92	300747	锐科激光	3,432,100.00	5.18
93	603566	普莱柯	3,421,874.00	5.17
94	603444	吉比特	3,408,411.00	5.15
95	002436	兴森科技	3,407,457.42	5.15
96	603279	景津环保	3,386,629.00	5.11
97	002271	东方雨虹	3,362,312.64	5.08
98	603345	安井食品	3,361,801.00	5.08
99	600694	大商股份	3,354,403.00	5.07
100	600997	开滦股份	3,329,227.00	5.03
101	688366	昊海生科	3,280,890.44	4.95
102	002859	洁美科技	3,179,926.04	4.80
103	002649	博彦科技	3,092,742.12	4.67
104	002541	鸿路钢构	3,092,029.30	4.67
105	002308	威创股份	3,081,151.00	4.65
106	000923	河钢资源	3,069,131.00	4.63
107	601233	桐昆股份	3,060,496.00	4.62
108	000657	中钨高新	3,058,683.00	4.62

109	002043	兔宝宝	3,058,351.00	4.62
110	300769	德方纳米	3,053,554.00	4.61
111	002139	拓邦股份	3,027,609.00	4.57
112	300799	左江科技	3,025,631.00	4.57
113	002326	永太科技	3,010,842.00	4.55
114	603348	文灿股份	2,992,911.40	4.52
115	002643	万润股份	2,972,168.00	4.49
116	000885	城发环境	2,963,164.00	4.47
117	002531	天顺风能	2,877,352.00	4.34
118	002651	利君股份	2,875,763.00	4.34
119	000568	泸州老窖	2,874,525.00	4.34
120	300119	瑞普生物	2,867,446.00	4.33
121	600073	上海梅林	2,847,684.00	4.30
122	002733	雄韬股份	2,818,120.00	4.26
123	688006	杭可科技	2,814,155.59	4.25
124	300037	新宙邦	2,808,969.00	4.24
125	600059	古越龙山	2,792,697.00	4.22
126	300398	飞凯材料	2,791,864.00	4.22
127	603801	志邦家居	2,777,703.00	4.19
128	688166	博瑞医药	2,767,609.65	4.18
129	002614	奥佳华	2,762,809.00	4.17
130	600338	西藏珠峰	2,760,166.00	4.17
131	000887	中鼎股份	2,757,599.00	4.16
132	600499	科达制造	2,752,097.00	4.16
133	000544	中原环保	2,738,862.00	4.14
134	600480	凌云股份	2,714,034.00	4.10
135	002344	海宁皮城	2,710,342.00	4.09
136	002519	银河电子	2,703,624.05	4.08
137	000983	山西焦煤	2,694,647.00	4.07
138	002792	通宇通讯	2,685,433.00	4.06
139	688278	特宝生物	2,675,201.07	4.04
140	002142	宁波银行	2,666,594.17	4.03
141	601678	滨化股份	2,664,325.00	4.02
142	603496	恒为科技	2,664,253.13	4.02
143	300800	力合科技	2,659,312.50	4.02
144	002567	唐人神	2,657,659.00	4.01
145	600641	万业企业	2,656,538.60	4.01
146	600438	通威股份	2,655,890.00	4.01
147	600736	苏州高新	2,652,264.44	4.01
148	300054	鼎龙股份	2,645,594.00	3.99
149	300571	平治信息	2,631,084.00	3.97
150	000059	华锦股份	2,590,139.00	3.91
151	000627	天茂集团	2,582,588.18	3.90

152	600884	杉杉股份	2,552,490.00	3.85
153	300036	超图软件	2,545,371.00	3.84
154	603489	八方股份	2,541,174.00	3.84
155	688098	申联生物	2,503,087.40	3.78
156	300680	隆盛科技	2,494,460.00	3.77
157	300559	佳发教育	2,486,132.00	3.75
158	300223	北京君正	2,483,493.00	3.75
159	688030	山石网科	2,483,465.55	3.75
160	002425	凯撒文化	2,475,661.00	3.74
161	000807	云铝股份	2,471,163.00	3.73
162	300679	电连技术	2,468,311.00	3.73
163	300572	安车检测	2,467,434.96	3.73
164	002017	东信和平	2,457,580.00	3.71
165	002625	光启技术	2,448,576.00	3.70
166	000723	美锦能源	2,438,827.00	3.68
167	002115	三维通信	2,438,445.08	3.68
168	600057	厦门象屿	2,437,919.00	3.68
169	300861	美畅股份	2,428,515.00	3.67
170	601166	兴业银行	2,427,128.00	3.67
171	002156	通富微电	2,418,978.15	3.65
172	002961	瑞达期货	2,406,581.00	3.63
173	002851	麦格米特	2,406,426.00	3.63
174	600874	创业环保	2,400,591.00	3.63
175	300068	南都电源	2,387,064.00	3.60
176	002064	华峰化学	2,362,787.00	3.57
177	603877	太平鸟	2,357,724.00	3.56
178	002313	日海智能	2,349,636.00	3.55
179	300143	盈康生命	2,348,678.00	3.55
180	688298	东方生物	2,348,378.75	3.55
181	603218	日月股份	2,335,129.10	3.53
182	688018	乐鑫科技	2,333,567.49	3.52
183	300775	三角防务	2,330,881.00	3.52
184	300294	博雅生物	2,326,582.07	3.51
185	601168	西部矿业	2,323,442.00	3.51
186	600812	华北制药	2,323,429.00	3.51
187	002479	富春环保	2,315,307.00	3.50
188	002042	华孚时尚	2,312,153.00	3.49
189	603260	合盛硅业	2,269,502.00	3.43
190	300226	上海钢联	2,268,424.20	3.43
191	688019	安集科技	2,260,765.35	3.41
192	300760	迈瑞医疗	2,260,731.00	3.41
193	601012	隆基股份	2,258,054.00	3.41
194	601567	三星医疗	2,256,848.00	3.41

195	688066	航天宏图	2,251,449.39	3.40
196	002389	航天彩虹	2,216,399.00	3.35
197	600682	南京新百	2,201,361.00	3.32
198	600096	云天化	2,181,142.00	3.29
199	688368	晶丰明源	2,179,859.85	3.29
200	002243	力合科创	2,157,862.00	3.26
201	002830	名雕股份	2,142,619.00	3.24
202	603869	新智认知	2,142,138.55	3.23
203	002918	蒙娜丽莎	2,136,402.00	3.23
204	002913	奥士康	2,103,118.94	3.18
205	688598	金博股份	2,095,577.52	3.16
206	688020	方邦股份	2,088,528.72	3.15
207	688007	光峰科技	2,088,069.51	3.15
208	688023	安恒信息	2,079,747.79	3.14
209	300639	凯普生物	2,073,528.00	3.13
210	002929	润建股份	2,065,150.00	3.12
211	300763	锦浪科技	2,058,591.00	3.11
212	300502	新易盛	2,045,916.00	3.09
213	300319	麦捷科技	2,032,598.00	3.07
214	002906	华阳集团	2,024,698.00	3.06
215	603003	龙宇燃油	2,019,267.99	3.05
216	601137	博威合金	2,006,728.00	3.03
217	000011	深物业 A	1,998,779.00	3.02
218	603979	金诚信	1,995,566.00	3.01
219	603876	鼎胜新材	1,987,004.00	3.00
220	688521	芯原股份	1,983,385.10	3.00
221	603508	思维列控	1,974,618.00	2.98
222	300451	创业慧康	1,973,987.42	2.98
223	000928	中钢国际	1,970,746.00	2.98
224	002376	新北洋	1,966,097.01	2.97
225	000519	中兵红箭	1,963,523.00	2.97
226	000910	大亚圣象	1,960,398.59	2.96
227	603806	福斯特	1,956,288.45	2.95
228	300896	爱美客	1,951,192.10	2.95
229	688050	爱博医疗	1,937,640.25	2.93
230	688218	江苏北人	1,937,238.98	2.93
231	000875	吉电股份	1,922,203.00	2.90
232	300369	绿盟科技	1,901,684.00	2.87
233	300075	数字政通	1,897,627.00	2.87
234	603108	润达医疗	1,888,869.80	2.85
235	603383	顶点软件	1,878,761.60	2.84
236	600330	天通股份	1,874,959.20	2.83
237	688516	奥特维	1,865,139.03	2.82

238	000921	海信家电	1,846,916.00	2.79
239	603690	至纯科技	1,846,474.00	2.79
240	688081	兴图新科	1,845,056.66	2.79
241	688139	海尔生物	1,844,697.27	2.79
242	300233	金城医药	1,833,355.00	2.77
243	300613	富瀚微	1,818,485.00	2.75
244	600111	北方稀土	1,810,153.00	2.73
245	002206	海利得	1,803,608.00	2.72
246	002055	得润电子	1,794,467.00	2.71
247	600308	华泰股份	1,783,340.00	2.69
248	603803	瑞斯康达	1,780,169.00	2.69
249	600063	皖维高新	1,767,401.00	2.67
250	603429	集友股份	1,757,095.00	2.65
251	300131	英唐智控	1,752,938.00	2.65
252	603337	杰克股份	1,745,899.00	2.64
253	688021	奥福环保	1,740,477.28	2.63
254	002025	航天电器	1,736,584.00	2.62
255	600850	电科数字	1,728,580.00	2.61
256	002291	星期六	1,727,900.00	2.61
257	002293	罗莱生活	1,727,698.00	2.61
258	002738	中矿资源	1,724,210.00	2.60
259	688266	泽璟制药	1,719,533.79	2.60
260	002497	雅化集团	1,695,872.00	2.56
261	600378	昊华科技	1,677,463.50	2.53
262	601515	东风股份	1,673,322.00	2.53
263	002106	莱宝高科	1,659,517.00	2.51
264	603093	南华期货	1,653,156.00	2.50
265	300850	新强联	1,633,404.44	2.47
266	002968	新大正	1,629,340.00	2.46
267	002138	顺络电子	1,608,377.00	2.43
268	600141	兴发集团	1,607,388.00	2.43
269	000498	山东路桥	1,607,193.12	2.43
270	300130	新国都	1,604,777.00	2.42
271	300777	中简科技	1,584,555.00	2.39
272	300132	青松股份	1,584,312.72	2.39
273	600590	泰豪科技	1,583,560.00	2.39
274	600748	上实发展	1,572,631.00	2.37
275	002628	成都路桥	1,562,203.00	2.36
276	002747	埃斯顿	1,556,682.00	2.35
277	688189	南新制药	1,541,343.21	2.33
278	603606	东方电缆	1,540,712.22	2.33
279	300394	天孚通信	1,532,059.00	2.31
280	600990	四创电子	1,506,033.50	2.27

281	600894	广日股份	1,505,811.00	2.27
282	600455	博通股份	1,500,965.00	2.27
283	600116	三峡水利	1,500,288.00	2.27
284	300750	宁德时代	1,498,336.00	2.26
285	000666	经纬纺机	1,489,761.00	2.25
286	601225	陕西煤业	1,488,709.00	2.25
287	688258	卓易信息	1,482,809.51	2.24
288	600877	声光电科	1,477,732.00	2.23
289	002410	广联达	1,476,760.00	2.23
290	603860	中公高科	1,475,783.00	2.23
291	300785	值得买	1,464,923.00	2.21
292	600587	新华医疗	1,461,315.00	2.21
293	002267	陕天然气	1,458,402.00	2.20
294	600825	新华传媒	1,450,438.00	2.19
295	000900	现代投资	1,445,875.70	2.18
296	600711	盛屯矿业	1,444,221.00	2.18
297	000915	华特达因	1,429,614.00	2.16
298	300263	隆华科技	1,429,539.00	2.16
299	603005	晶方科技	1,427,712.80	2.16
300	688268	华特气体	1,426,214.03	2.15
301	603588	高能环境	1,424,510.00	2.15
302	002145	中核钛白	1,410,267.00	2.13
303	002283	天润工业	1,409,795.00	2.13
304	002928	华夏航空	1,401,186.00	2.12
305	002318	久立特材	1,393,428.00	2.10
306	688365	光云科技	1,392,574.73	2.10
307	300316	晶盛机电	1,390,932.00	2.10
308	002880	卫光生物	1,389,390.94	2.10
309	002110	三钢闽光	1,387,318.00	2.09
310	600668	尖峰集团	1,376,518.88	2.08
311	600007	中国国贸	1,370,038.00	2.07
312	300666	江丰电子	1,363,286.00	2.06
313	002895	川恒股份	1,358,816.60	2.05
314	002351	漫步者	1,358,239.00	2.05
315	300463	迈克生物	1,357,127.99	2.05
316	600602	云赛智联	1,355,925.00	2.05
317	002061	浙江交科	1,352,229.00	2.04
318	688408	中信博	1,350,026.37	2.04
319	000977	浪潮信息	1,339,140.52	2.02
320	000822	山东海化	1,334,260.00	2.01
321	002807	江阴银行	1,332,456.00	2.01
322	002274	华昌化工	1,326,977.00	2.00

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603613	国联股份	8,829,996.29	13.33
2	300496	中科创达	7,396,642.00	11.17
3	002756	永兴材料	7,058,150.00	10.66
4	002430	杭氧股份	6,876,748.00	10.38
5	300363	博腾股份	6,721,708.78	10.15
6	603267	鸿远电子	6,524,166.26	9.85
7	002850	科达利	6,496,831.00	9.81
8	000799	酒鬼酒	6,485,200.00	9.79
9	000733	振华科技	6,266,712.00	9.46
10	600123	兰花科创	6,048,149.00	9.13
11	002407	多氟多	6,015,049.00	9.08
12	300395	菲利华	5,827,145.00	8.80
13	002258	利尔化学	5,798,000.00	8.76
14	688005	容百科技	5,582,691.53	8.43
15	300012	华测检测	5,505,970.95	8.31
16	603456	九洲药业	5,459,889.84	8.24
17	601898	中煤能源	5,302,973.00	8.01
18	300751	迈为股份	5,096,844.00	7.70
19	002013	中航机电	5,069,503.00	7.66
20	000933	神火股份	5,019,003.18	7.58
21	300327	中颖电子	4,997,328.30	7.55
22	603008	喜临门	4,966,986.00	7.50
23	300726	宏达电子	4,951,269.00	7.48
24	300685	艾德生物	4,929,822.00	7.44
25	600110	诺德股份	4,910,568.50	7.42
26	601677	明泰铝业	4,817,875.00	7.28
27	601636	旗滨集团	4,804,137.00	7.25
28	300073	当升科技	4,736,571.00	7.15
29	300724	捷佳伟创	4,732,512.93	7.15
30	300696	爱乐达	4,652,125.90	7.02
31	002322	理工环科	4,646,788.80	7.02
32	002245	蔚蓝锂芯	4,645,256.45	7.01
33	300755	华致酒行	4,619,795.20	6.98
34	603599	广信股份	4,493,168.00	6.78
35	002409	雅克科技	4,467,289.24	6.75
36	300633	开立医疗	4,452,033.00	6.72
37	300725	药石科技	4,430,824.91	6.69
38	603678	火炬电子	4,406,462.00	6.65

39	600456	宝钛股份	4,399,967.00	6.64
40	002190	成飞集成	4,378,830.00	6.61
41	002568	百润股份	4,265,711.28	6.44
42	300390	天华超净	4,261,039.00	6.43
43	002709	天赐材料	4,249,963.00	6.42
44	002402	和而泰	4,181,617.00	6.31
45	603026	石大胜华	4,137,588.96	6.25
46	300059	东方财富	4,124,402.65	6.23
47	002539	云图控股	4,073,460.00	6.15
48	000818	航锦科技	4,054,222.20	6.12
49	300037	新宙邦	4,051,402.66	6.12
50	603127	昭衍新药	4,047,597.40	6.11
51	300672	国科微	4,037,206.00	6.10
52	300799	左江科技	3,970,705.00	6.00
53	300748	金力永磁	3,935,800.12	5.94
54	603180	金牌厨柜	3,926,498.58	5.93
55	300470	中密控股	3,925,105.00	5.93
56	300596	利安隆	3,915,438.00	5.91
57	000683	远兴能源	3,894,513.00	5.88
58	300439	美康生物	3,849,595.00	5.81
59	300604	长川科技	3,806,911.90	5.75
60	688388	嘉元科技	3,785,481.94	5.72
61	688100	威胜信息	3,714,136.67	5.61
62	002585	双星新材	3,699,680.00	5.59
63	300568	星源材质	3,664,755.20	5.53
64	002308	威创股份	3,659,800.00	5.53
65	300458	全志科技	3,628,774.00	5.48
66	603279	景津环保	3,562,376.00	5.38
67	300573	兴齐眼药	3,561,001.00	5.38
68	300659	中孚信息	3,558,197.60	5.37
69	603348	文灿股份	3,539,612.26	5.34
70	000059	华锦股份	3,521,911.00	5.32
71	000657	中钨高新	3,517,010.00	5.31
72	002920	德赛西威	3,515,195.25	5.31
73	603128	华贸物流	3,416,871.30	5.16
74	603345	安井食品	3,412,736.00	5.15
75	300171	东富龙	3,380,687.00	5.11
76	002254	泰和新材	3,365,585.00	5.08
77	300638	广和通	3,357,256.30	5.07
78	601678	滨化股份	3,312,329.00	5.00
79	300747	锐科激光	3,274,154.00	4.94
80	300119	瑞普生物	3,248,636.00	4.91
81	000885	城发环境	3,195,068.70	4.82

82	688116	天奈科技	3,183,167.13	4.81
83	000923	河钢资源	3,179,931.00	4.80
84	603444	吉比特	3,169,397.00	4.79
85	600882	妙可蓝多	3,163,707.00	4.78
86	002271	东方雨虹	3,162,060.79	4.77
87	002240	盛新锂能	3,150,330.00	4.76
88	002649	博彦科技	3,127,973.00	4.72
89	300662	科锐国际	3,109,674.00	4.70
90	002158	汉钟精机	3,094,815.00	4.67
91	300679	电连技术	3,061,609.00	4.62
92	688188	柏楚电子	3,053,275.22	4.61
93	300068	南都电源	3,017,890.55	4.56
94	603801	志邦家居	2,998,773.60	4.53
95	603566	普莱柯	2,998,268.00	4.53
96	002541	鸿路钢构	2,976,177.20	4.49
97	002614	奥佳华	2,971,871.15	4.49
98	002034	旺能环境	2,967,507.24	4.48
99	688366	昊海生科	2,959,083.93	4.47
100	600031	三一重工	2,923,616.00	4.41
101	002833	弘亚数控	2,919,843.20	4.41
102	688006	杭可科技	2,919,051.97	4.41
103	002344	海宁皮城	2,909,011.00	4.39
104	300571	平治信息	2,877,233.00	4.34
105	002851	麦格米特	2,855,768.46	4.31
106	600997	开滦股份	2,855,496.00	4.31
107	000902	新洋丰	2,843,097.00	4.29
108	600480	凌云股份	2,814,509.00	4.25
109	002531	天顺风能	2,806,037.00	4.24
110	600736	苏州高新	2,795,186.35	4.22
111	002733	雄韬股份	2,790,439.00	4.21
112	600596	新安股份	2,781,395.00	4.20
113	603733	仙鹤股份	2,770,331.00	4.18
114	600438	通威股份	2,710,217.00	4.09
115	300502	新易盛	2,706,682.12	4.09
116	300373	扬杰科技	2,704,827.00	4.08
117	600694	大商股份	2,699,290.00	4.08
118	002519	银河电子	2,683,429.30	4.05
119	600641	万业企业	2,671,319.00	4.03
120	600338	西藏珠峰	2,666,074.80	4.03
121	300653	正海生物	2,653,332.02	4.01
122	300034	钢研高纳	2,640,370.60	3.99
123	002025	航天电器	2,606,983.76	3.94
124	002597	金禾实业	2,600,656.00	3.93

125	000723	美锦能源	2,588,487.00	3.91
126	300639	凯普生物	2,585,717.81	3.90
127	002313	日海智能	2,553,816.00	3.86
128	300223	北京君正	2,542,225.00	3.84
129	002043	兔宝宝	2,541,381.00	3.84
130	002115	三维通信	2,539,404.47	3.83
131	688166	博瑞医药	2,536,312.31	3.83
132	002567	唐人神	2,512,169.00	3.79
133	300559	佳发教育	2,505,920.89	3.78
134	002156	通富微电	2,490,857.70	3.76
135	688016	心脉医疗	2,477,509.88	3.74
136	000807	云铝股份	2,471,467.00	3.73
137	000887	中鼎股份	2,471,398.61	3.73
138	601233	桐昆股份	2,442,748.00	3.69
139	002064	华峰化学	2,440,194.00	3.68
140	600884	杉杉股份	2,426,373.00	3.66
141	601168	西部矿业	2,420,526.00	3.66
142	000921	海信家电	2,416,685.00	3.65
143	600812	华北制药	2,410,915.00	3.64
144	600057	厦门象屿	2,406,756.92	3.63
145	300226	上海钢联	2,403,372.56	3.63
146	603496	恒为科技	2,401,141.00	3.63
147	600874	创业环保	2,393,552.87	3.61
148	002651	利君股份	2,392,818.00	3.61
149	300143	盈康生命	2,382,187.72	3.60
150	002792	通宇通讯	2,369,661.00	3.58
151	002017	东信和平	2,367,014.00	3.57
152	688066	航天宏图	2,364,107.16	3.57
153	002425	凯撒文化	2,358,241.00	3.56
154	600096	云天化	2,353,419.00	3.55
155	300075	数字政通	2,351,038.00	3.55
156	000627	天茂集团	2,336,788.00	3.53
157	300613	富瀚微	2,329,641.10	3.52
158	000983	山西焦煤	2,312,645.00	3.49
159	603383	顶点软件	2,310,741.30	3.49
160	603869	新智认知	2,301,114.00	3.47
161	300394	天孚通信	2,289,239.40	3.46
162	002243	力合科创	2,283,889.00	3.45
163	601311	骆驼股份	2,276,473.65	3.44
164	002830	名雕股份	2,270,644.69	3.43
165	002479	富春环保	2,266,084.00	3.42
166	688122	西部超导	2,260,013.13	3.41
167	300294	博雅生物	2,253,978.00	3.40

168	603877	太平鸟	2,242,320.00	3.39
169	300760	迈瑞医疗	2,242,164.00	3.39
170	601012	隆基股份	2,241,822.40	3.39
171	688098	申联生物	2,231,736.19	3.37
172	002055	得润电子	2,220,195.00	3.35
173	002326	永太科技	2,191,778.00	3.31
174	002906	华阳集团	2,187,018.00	3.30
175	688368	晶丰明源	2,179,888.85	3.29
176	300130	新国都	2,178,315.20	3.29
177	000875	吉电股份	2,170,370.00	3.28
178	688158	优刻得	2,153,951.78	3.25
179	603979	金诚信	2,136,478.00	3.23
180	000928	中钢国际	2,113,285.00	3.19
181	300572	安车检测	2,107,712.64	3.18
182	603489	八方股份	2,099,343.16	3.17
183	688019	安集科技	2,095,386.97	3.16
184	000011	深物业 A	2,093,292.00	3.16
185	603260	合盛硅业	2,090,846.00	3.16
186	300680	隆盛科技	2,086,906.00	3.15
187	688020	方邦股份	2,084,594.60	3.15
188	601137	博威合金	2,083,388.00	3.15
189	603003	龙宇燃油	2,082,778.50	3.15
190	300036	超图软件	2,081,687.00	3.14
191	603876	鼎胜新材	2,066,792.00	3.12
192	603337	杰克股份	2,031,643.00	3.07
193	300763	锦浪科技	2,019,572.00	3.05
194	000498	山东路桥	2,017,174.72	3.05
195	600308	华泰股份	1,999,023.00	3.02
196	603218	日月股份	1,994,966.16	3.01
197	688521	芯原股份	1,980,509.76	2.99
198	603806	福斯特	1,977,338.15	2.99
199	002913	奥士康	1,970,789.78	2.98
200	000910	大亚圣象	1,944,827.03	2.94
201	000666	经纬纺机	1,942,848.00	2.93
202	300896	爱美客	1,936,042.76	2.92
203	000519	中兵红箭	1,925,733.00	2.91
204	688018	乐鑫科技	1,915,134.26	2.89
205	002376	新北洋	1,883,625.74	2.84
206	688081	兴图新科	1,881,193.49	2.84
207	300666	江丰电子	1,881,164.00	2.84
208	601166	兴业银行	1,877,259.82	2.83
209	688007	光峰科技	1,872,339.97	2.83
210	688298	东方生物	1,870,050.30	2.82

211	300233	金城医药	1,866,030.80	2.82
212	603803	瑞斯康达	1,855,198.00	2.80
213	300031	宝通科技	1,850,599.77	2.79
214	002859	洁美科技	1,834,032.80	2.77
215	600111	北方稀土	1,804,213.00	2.72
216	300737	科顺股份	1,789,140.60	2.70
217	300767	震安科技	1,769,525.00	2.67
218	603508	思维列控	1,758,334.00	2.66
219	002961	瑞达期货	1,757,979.00	2.65
220	300369	绿盟科技	1,757,274.44	2.65
221	000968	蓝焰控股	1,755,153.00	2.65
222	600141	兴发集团	1,751,149.00	2.64
223	002918	蒙娜丽莎	1,749,546.00	2.64
224	600063	皖维高新	1,746,460.00	2.64
225	300203	聚光科技	1,734,215.00	2.62
226	002293	罗莱生活	1,729,490.00	2.61
227	688218	江苏北人	1,722,925.42	2.60
228	300476	胜宏科技	1,718,646.96	2.60
229	601515	东风股份	1,716,404.60	2.59
230	601567	三星医疗	1,697,338.00	2.56
231	600378	昊华科技	1,689,925.24	2.55
232	002267	陕天然气	1,658,358.00	2.50
233	600330	天通股份	1,652,742.00	2.50
234	002291	星期六	1,626,159.00	2.46
235	300055	万邦达	1,620,655.47	2.45
236	688266	泽璟制药	1,611,038.69	2.43
237	600602	云赛智联	1,607,322.00	2.43
238	688021	奥福环保	1,605,937.51	2.43
239	000544	中原环保	1,599,943.00	2.42
240	300131	英唐智控	1,597,921.00	2.41
241	002283	天润工业	1,596,373.00	2.41
242	002274	华昌化工	1,595,129.00	2.41
243	603606	东方电缆	1,585,791.00	2.39
244	603690	至纯科技	1,572,097.00	2.37
245	002544	杰赛科技	1,569,246.00	2.37
246	600990	四创电子	1,549,726.00	2.34
247	300132	青松股份	1,545,467.72	2.33
248	002497	雅化集团	1,544,285.00	2.33
249	688078	龙软科技	1,535,100.99	2.32
250	688278	特宝生物	1,534,978.56	2.32
251	000951	中国重汽	1,531,998.64	2.31
252	600668	尖峰集团	1,527,675.70	2.31
253	603588	高能环境	1,518,259.80	2.29

254	000568	泸州老窖	1,515,466.00	2.29
255	002628	成都路桥	1,504,088.00	2.27
256	600748	上实发展	1,503,263.00	2.27
257	002484	江海股份	1,501,083.40	2.27
258	688268	华特气体	1,500,950.49	2.27
259	002138	顺络电子	1,498,217.00	2.26
260	300777	中简科技	1,478,210.00	2.23
261	603860	中公高科	1,477,116.00	2.23
262	002318	久立特材	1,473,737.00	2.23
263	002747	埃斯顿	1,469,186.46	2.22
264	600523	贵航股份	1,465,294.00	2.21
265	300316	晶盛机电	1,454,404.00	2.20
266	002139	拓邦股份	1,428,742.00	2.16
267	300785	值得买	1,422,733.00	2.15
268	688365	光云科技	1,421,429.48	2.15
269	000900	现代投资	1,416,817.60	2.14
270	002151	北斗星通	1,415,794.16	2.14
271	300567	精测电子	1,410,158.00	2.13
272	300775	三角防务	1,408,614.00	2.13
273	000977	浪潮信息	1,398,644.28	2.11
274	002410	广联达	1,389,271.00	2.10
275	600590	泰豪科技	1,378,665.90	2.08
276	603819	神力股份	1,378,542.30	2.08
277	002110	三钢闽光	1,374,580.00	2.08
278	300800	力合科技	1,372,171.50	2.07
279	300762	上海瀚讯	1,348,893.56	2.04
280	002351	漫步者	1,346,138.00	2.03
281	600059	古越龙山	1,344,850.00	2.03
282	600825	新华传媒	1,342,294.01	2.03
283	002364	中恒电气	1,342,146.00	2.03
284	002745	木林森	1,336,045.00	2.02
285	300451	创业慧康	1,335,634.00	2.02
286	002197	证通电子	1,334,548.00	2.02
287	000882	华联股份	1,334,117.00	2.01
288	300463	迈克生物	1,329,476.40	2.01

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,192,145,582.27
卖出股票收入（成交）总额	1,082,375,530.57

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,304,391.20	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	123,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,427,391.20	0.64

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	13,040	1,304,391.20	0.58
2	113052	兴业转债	1,230	123,000.00	0.06

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	--------	------	-------	------

		卖)	(元)	动(元)	
IC2201	IC2201	4	5,902,240.00	151,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					151,880.00
股指期货投资本期收益(元)					526,281.05
股指期货投资本期公允价值变动(元)					151,880.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的。本报告期进行了少量的多头套保。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	944,177.69
2	应收证券清算款	451,483.07
3	应收股利	-
4	应收利息	26,947.23
5	应收申购款	1,178,859.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,601,467.88

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证 1000 增强 A	4,278	7,439.73	6,187,085.60	19.44%	25,640,087.09	80.56%
创金合信中证 1000 增强 C	6,089	15,700.33	63,842,774.29	66.78%	31,756,542.83	33.22%
合计	10,207	12,484.23	70,029,859.89	54.96%	57,396,629.92	45.04%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证 1000 增强 A	88,715.72	0.28%

	创金合信中证 1000 增强 C	10,471.46	0.01%
	合计	99,187.18	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信中证 1000 增强 A	0~10
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证 1000 增强 A	0
	创金合信中证 1000 增强 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	3,392.50	0.00	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	3,392.50	0.00	0.00	0.00	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	创金合信中证 1000 增强 A	创金合信中证 1000 增强 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 22 日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	40,665,749.72	6,381,630.84
本报告期基金总申购份额	72,641,410.60	236,335,930.88
减：报告期基金总赎回份额	81,479,987.63	147,118,244.60
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	31,827,172.69	95,599,317.12
-------------	---------------	---------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、自 2021 年 10 月 29 日起，刘学民先生不再担任创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人，钱龙海先生担任创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人；

2、自 2021 年 10 月 29 日起，屈嫔女士担任创金合信基金管理有限公司董事；

3、自 2021 年 3 月 3 日起，杨健先生不再担任创金合信基金管理有限公司非职工代表监事，宋明华先生担任创金合信基金管理有限公司非职工代表监事。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 55,000.00 元，该审计机构连续提供审计服务的年限为 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未发生受到监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	1,573,636,367.67	69.41%	659,931.71	81.46%	-
金元证券	2	693,559,819.99	30.59%	150,200.60	18.54%	-

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。

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
第一创业证券	443,265.70	14.71%	600,000.00	5.66%	-	-
金元证券	2,570,941.60	85.29%	10,000,000.00	94.34%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年第四季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
2	创金合信基金管理有限公司关于旗下指数基金编制方法及查询路径的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30

3	创金合信基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
4	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-25
5	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-09
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加招赢通平台费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
7	创金合信基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
8	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
9	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
10	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司实施费率优惠的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
11	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-10
12	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新提示性公告	公司官网、上海证券报	2021-07-14
13	创金合信基金管理有限公司旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	公司官网、上海证券报	2021-07-16
14	创金合信基金管理有限公司旗下基金 2021 年度第二季度报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
15	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
16	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-13
17	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度中期报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
18	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
19	创金合信基金管理有限公司 旗下基金 2021 年度第三季度报告提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金	2021-10-27

		电子披露网站	
20	创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
21	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、定期定额投资最低金额限制的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2021-11-24

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101 - 20210112	22,392,210.38	0.00	22,392,210.38	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念,创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力,并在客户数量和规模上取得快速突破。截至 2021 年 12 月 31 日,创金合信基金共管理 79 只公募基金,公募管理规模 829 亿元。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年度报告原文。

13.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

13.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日