

创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信沪深300增强	
基金主代码	002310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	465,869,233.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强 C
下属分级基金的交易代码	002310	002315
报告期末下属分级基金的份额总额	218,855,457.26份	247,013,775.82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	沪深300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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2017年		2016年		2015年12月31日（基金 合同生效日）-2015年1 2月31日	
	创金合信 沪深300 增强A	创金合信 沪深300 增强C	创金合信 沪深300 增强A	创金合信 沪深300 增强C	创金合信 沪深300增 强A	创金合信 沪深300增 强C
本期已实 现收益	42,838,6 14.18	4,505,49 4.39	-564,15 0.41	-245,87 4.56	200.00	200.00
本期利润	50,558,6 39.50	3,417,58 7.86	-1,098,8 12.30	-545,59 0.40	200.00	200.00
加权平均 基金份额	0.2346	0.1353	-0.1097	-0.0985	-	-

本期利润						
本期基金份额净值增长率	24.59%	24.65%	-4.68%	-4.13%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0053	0.0056	-0.0554	-0.0498	-	-
期末基金资产净值	229,852,398.60	259,516,735.93	204,205,414.52	5,200,757.64	5,000,200.00	5,000,200.00
期末基金份额净值	1.0502	1.0506	0.9532	0.9587	1.0000	1.0000

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。

3.2 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

创金合信沪深300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	5.40%	0.69%	4.84%	0.76%	0.56%	-0.07%
过去六个月	11.20%	0.61%	9.47%	0.66%	1.73%	-0.05%
过去一年	24.59%	0.57%	20.70%	0.60%	3.89%	-0.03%
自基金合同生效起至今	18.76%	1.05%	7.00%	1.03%	11.76%	0.02%

创金合信沪深300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	5.45%	0.69%	4.84%	0.76%	0.61%	-0.07%
过去六个月	11.23%	0.61%	9.47%	0.66%	1.76%	-0.05%
过去一年	24.65%	0.57%	20.70%	0.60%	3.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.51%	1.05%	7.00%	1.03%	12.51%	0.02%

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

创金合信沪深300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

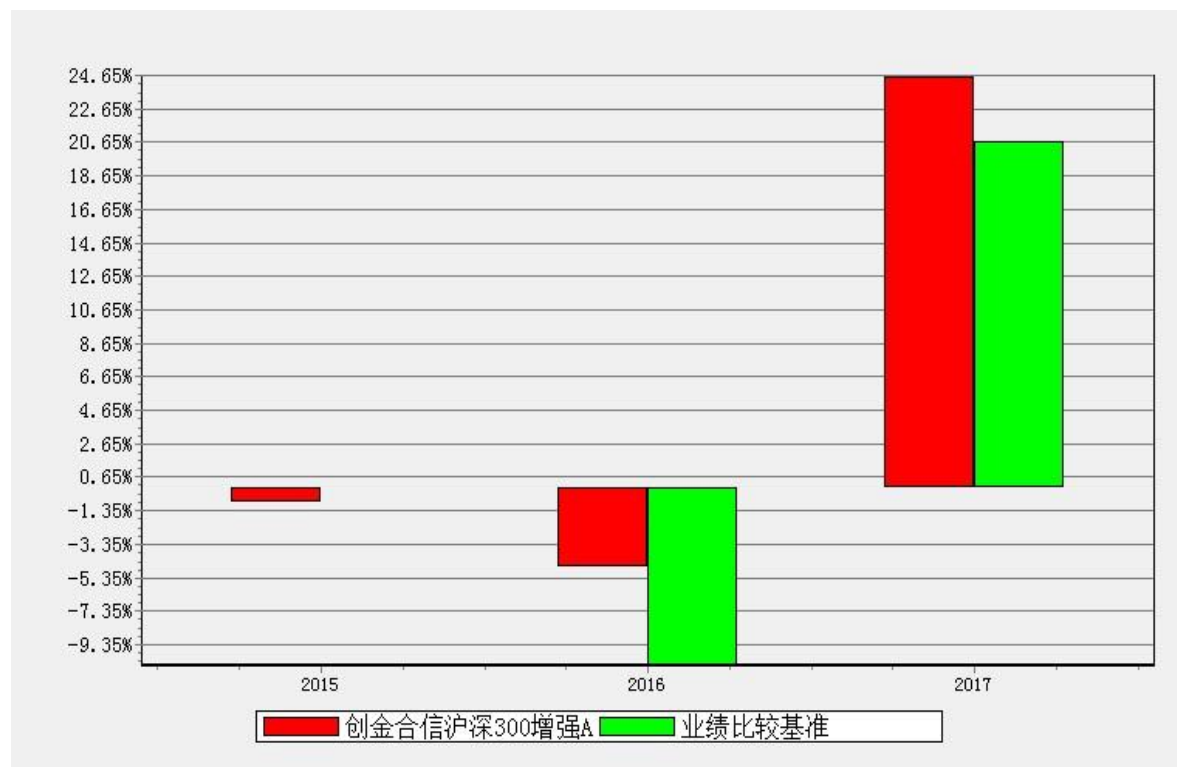


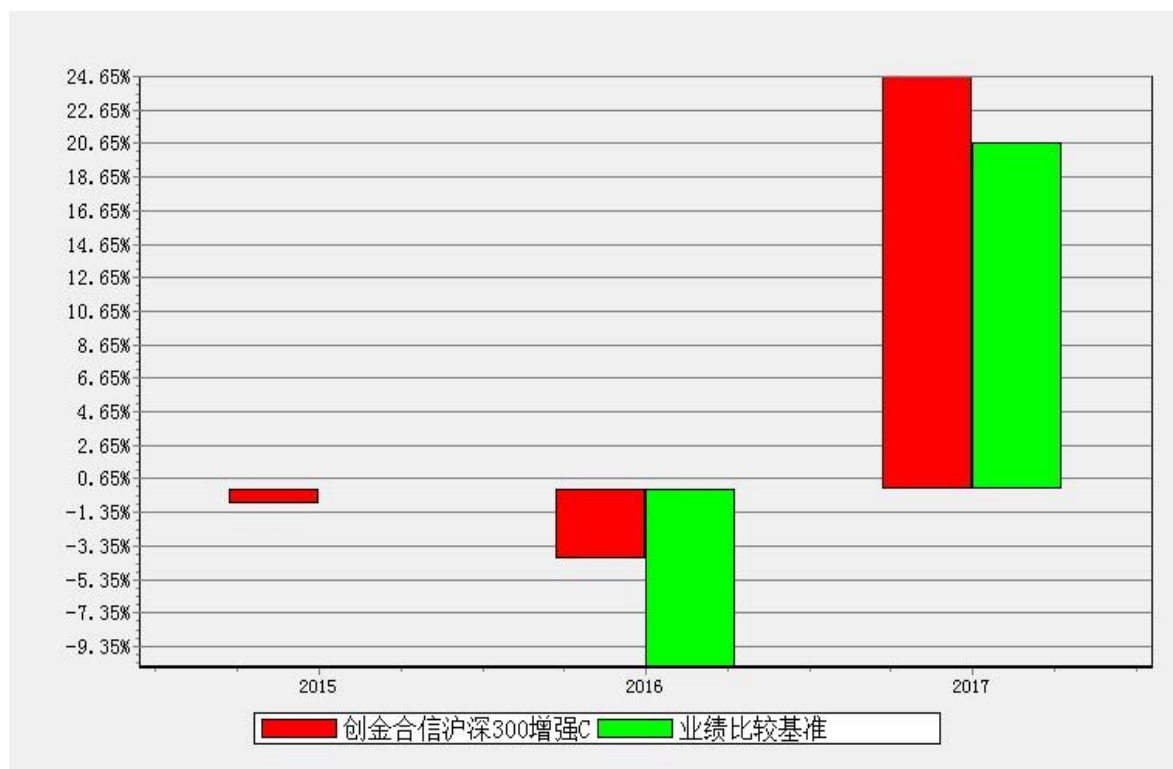
创金合信沪深300增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年12月31日-2017年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

创金合信沪深300增强A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	1.38	30,128,033.12	31,514.90	30,159,548.02	-
合计	1.38	30,128,033.12	31,514.90	30,159,548.02	-

创金合信沪深300增强C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	1.45	3,596,299.75	30,516,397.27	34,112,697.02	-
合计	1.45	3,596,299.75	30,516,397.27	34,112,697.02	-

§ 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。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

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2017年12月31日，本公司共管理29只公募基金，其中混合型产品11只、指数型产品4只、债券型产品8只、股票型产品4只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约149.41亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程志田	本基金经 理、量化 投资部总 监	2015-12- 31	-	11年	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年1月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。
庞世恩	本基金经 理	2016-01- 08	-	6年	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融

					工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金销售管理办法》和《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。本基金的投资范围、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

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

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

4、公平交易监控

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共8次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信沪深300增强A基金份额净值为1.0502元；本报告期内，基金份额净值增长率为24.59%，同期业绩比较基准收益率为20.70%；截至报告期末创金合信沪深300增强C基金份额净值为1.0506元；本报告期内，基金份额净值增长率为24.65%，同期业绩比较基准收益率为20.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观上看，经济基本面韧性较强，全年增长率超预期。考虑到在房地产政策趋紧的情况下，房地产成交量萎缩，投资房市的资金需要重新配置，在海外投资受限的情况下，权益类资产有望在投资者投资配置中提升权重。从投资情绪来看，市场已在一定程度上回暖，投资者风险偏好提升，爆款基金密集发行，增量资金入市情况明显。

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，本基金已实施利润分配64,272,245.04元，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，在本报告期内，基金托管人—招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2017年12月31日的资产负债表、2017年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。 § 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	12,435,126.19	11,077,737.55
结算备付金	1,326,789.04	88,701.48
存出保证金	44,556.59	3,768.48
交易性金融资产	475,603,088.47	198,542,580.46
其中：股票投资	450,288,596.27	198,542,580.46
基金投资	-	-
债券投资	25,314,492.20	-

资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	293,373.42	-
应收利息	361,571.61	11,774.86
应收股利	-	-
应收申购款	114,371.46	5,491.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	490,178,876.78	209,730,054.59
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	4,809.39	3,054.09
应付管理人报酬	229,142.26	41,472.39
应付托管费	28,642.77	5,184.04
应付销售服务费	7,186.14	727.61
应付交易费用	398,123.29	233,444.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	141,838.40	40,000.23
负债合计	809,742.25	323,882.43
所有者权益:		

实收基金	465,869,233.08	219,660,945.77
未分配利润	23,499,901.45	-10,254,773.61
所有者权益合计	489,369,134.53	209,406,172.16
负债和所有者权益总计	490,178,876.78	209,730,054.59

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额总额465,869,233.08份，其中下属A类基金份额218,855,457.26份，C类基金份额247,013,775.82份。下属A类基金份额净值1.0502元，C类基金份额净值1.0506元。

7.2 利润表

会计主体：创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
一、收入	59,961,071.60	-1,066,228.33
1. 利息收入	155,589.51	16,972.22
其中：存款利息收入	137,043.44	16,972.22
债券利息收入	18,223.71	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	322.36	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	53,057,884.70	-290,615.09
其中：股票投资收益	48,343,327.07	-469,250.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,410.83	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	4,707,146.80	178,634.92
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,632,118.79	-834,377.73
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	115,478.60	41,792.27
减：二、费用	5,984,844.24	578,174.37
1. 管理人报酬	2,050,404.62	109,469.67
2. 托管费	256,300.64	13,683.69
3. 销售服务费	27,017.53	5,043.57
4. 交易费用	3,470,369.12	378,370.84
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	180,752.33	71,606.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	53,976,227.36	-1,644,402.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	53,976,227.36	-1,644,402.70

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017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)	219,660,945.77	-10,254,773.61	209,406,172.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,976,227.36	53,976,227.36

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)	246,208,287.31	44,050,692.74	290,258,980.05
其中：1. 基金申购款	306,529,618.04	49,426,700.74	355,956,318.78
2. 基金赎回款	-60,321,330.73	-5,376,008.00	-65,697,338.73
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)	-	-64,272,245.04	-64,272,245.04
五、期末所有者权益(基金净值)	465,869,233.08	23,499,901.45	489,369,134.53
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016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)	10,000,000.00	400.00	10,000,400.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,644,402.70	-1,644,402.70
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)	209,660,945.77	-8,610,770.91	201,050,174.86
其中：1. 基金申购款	218,984,563.23	-8,972,737.82	210,011,825.41
2. 基金赎回款	-9,323,617.46	361,966.91	-8,961,650.55
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)	219,660,945.77	-10,254,773.61	209,406,172.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信沪深300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[2015]3045号《关于准予创金合信沪深300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《创金合信沪深300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10,000,000.00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(2015)第1504号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2015年12月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00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10,000,000.00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《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300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》、《创金合信沪深300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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于2017年12月31日，本基金的基金资产净值为人民币489,369,134.53元，且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本基金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。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

7.4.6 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
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

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年1 2月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	2,129,441,207.89	58.49%	35,252,486.84	10.99%

7.4.7.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017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	688,256.82	48.41%	338,123.23	84.93%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日至2016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	25,482.05	8.80%	-	-

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

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

7.4.7.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31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	29,876,640.77	100.00%	-	-

7.4.7.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购	成交	占当期债券回购

	额	成交总额的比例	金额	成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,050,404.62	109,469.67
其中：支付销售机构的客户维护费	14,196.59	775.36

注：支付基金管理人 创金合信的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值X 0.80% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	256,300.64	13,683.69

注：支付基金托管人 招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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：

日托管费=前一日基金资产净值X 0.10% / 当年天数。

7.4.7.2.3 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 2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强 C	合计
招商银行	-	137.24	137.24

创金合信直销	-	25,513.03	25,513.03
第一创业	-	6.58	6.58
合计	-	25,656.85	25,656.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信沪深300增强 A	创金合信沪深300增强 C	合计
创金合信直销	-	4,880.45	4,880.45
合计	-	4,880.45	4,880.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.1%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：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值× 0.1%/ 当年天数。

7.4.7.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信沪深300增强A

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01 日至2017年12 月31日	上年度可比期 间 2016年01月01 日至2016年12 月31日
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00

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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.28%	2.33%

创金合信沪深300增强C

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01 日至2017年12 月31日	上年度可比期 间 2016年01月01 日至2016年12 月31日
基金合同生效日（2015年12月31日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.02%	92.17%

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.7.5 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 2017年01月01日至2017年12 月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016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
招商银行股份有限公司	12,435,126.	112,840.06	11,077,737.5	16,235.22

	19		5	
--	----	--	---	--

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.8 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,755.25	20,755.25	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
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
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	新债流通受限	100.00	100.00	1,079	107,900.00	107,900.00	-

7.4.8.2 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	复牌开盘	数量(股)	期末成本	期末估值	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	------	------	----

				单价		单价		总额	总额	
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	89,300	3,341,888.76	3,388,042.00	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项停牌	9.15	2018-02-09	8.24	328,400	2,787,826.50	3,004,860.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项停牌	11.40	-	-	240,600	3,062,894.65	2,742,840.00	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大事项停牌	14.86	2018-03-07	15.05	41,286	630,947.04	613,509.96	-
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项停牌	15.79	2018-01-10	17.30	37,300	593,141.00	588,967.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大事项停牌	32.14	2018-01-08	30.15	13,500	372,425.97	433,890.00	-
603986	兆易创新	2017-11-01	重大事项停牌	163.12	2018-03-02	150.00	2,300	287,792.81	375,176.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	16.03	-	-	21,000	339,518.84	336,630.00	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.9 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2017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438,672,400.65元，属于第二层次的余额为36,930,687.82元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次198,127,715.46元，第二层次414,865.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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2017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(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	450,288,596.27	91.86
	其中：股票	450,288,596.27	91.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,314,492.20	5.16

	其中：债券	25,314,492.20	5.16
	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	13,761,915.23	2.81
8	其他各项资产	813,873.08	0.17
9	合计	490,178,876.78	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,549,934.00	2.16
C	制造业	131,660,485.70	26.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,574,286.00	2.37
E	建筑业	16,774,538.00	3.43
F	批发和零售业	8,238,428.00	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	9,898,998.00	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,399,137.00	1.51
J	金融业	143,904,347.73	29.41
K	房地产业	13,985,442.00	2.86
L	租赁和商务服务业	1,806,955.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,583,268.00	1.55

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	363,375,819.43	74.25

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	446,930.00	0.09
B	采矿业	1,045,830.00	0.21
C	制造业	49,304,769.04	10.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,377,725.20	0.49
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,353,920.49	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	4,817,891.76	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,900,559.55	1.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	304,704.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,328,123.60	2.11
S	综合	-	-
	合计	86,912,776.84	17.76

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	601628	中国人寿	565,239	17,211,527.55	3.52
2	600519	贵州茅台	23,600	16,460,764.00	3.36
3	601318	中国平安	229,600	16,067,408.00	3.28
4	600104	上汽集团	438,500	14,049,540.00	2.87
5	000333	美的集团	243,750	13,511,062.50	2.76
6	601398	工商银行	1,916,300	11,881,060.00	2.43
7	601668	中国建筑	1,265,400	11,413,908.00	2.33
8	000725	京东方 A	1,919,400	11,113,326.00	2.27
9	601006	大秦铁路	1,091,400	9,898,998.00	2.02
10	600585	海螺水泥	322,600	9,461,858.00	1.93

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.cjhxfund.com 网站的年度报告正文。

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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	期末公允价值	公允价值占基金资产净值比例 (%)
1	601801	皖新传媒	518,620	5,486,999.60	1.12
2	000039	中集集团	229,000	5,232,650.00	1.07
3	000513	丽珠集团	76,500	5,083,425.00	1.04
4	600755	厦门国贸	458,900	4,634,890.00	0.95
5	600350	山东高速	719,600	4,310,404.00	0.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.cjhxfund.com 网站的年度报告正文。

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	600519	贵州茅台	32,755,939.99	15.64
2	601668	中国建筑	32,163,034.00	15.36
3	601628	中国人寿	30,495,585.10	14.56
4	601318	中国平安	29,167,889.24	13.93
5	600900	长江电力	27,538,580.46	13.15
6	000333	美的集团	25,578,191.83	12.21
7	600999	招商证券	25,142,025.61	12.01
8	600837	海通证券	24,123,917.71	11.52
9	601186	中国铁建	23,802,544.00	11.37
10	000069	华侨城 A	21,357,927.86	10.20
11	600585	海螺水泥	21,223,865.81	10.14
12	002304	洋河股份	20,486,598.00	9.78
13	600309	万华化学	20,486,573.12	9.78
14	000651	格力电器	20,108,083.00	9.60
15	600104	上汽集团	19,804,424.00	9.46
16	601601	中国太保	18,226,461.21	8.70

17	002415	海康威视	18,164,151.74	8.67
18	000002	万科 A	18,033,326.19	8.61
19	601398	工商银行	17,788,439.64	8.49
20	601088	中国神华	17,321,114.06	8.27
21	000725	京东方 A	16,709,131.00	7.98
22	601006	大秦铁路	16,411,974.64	7.84
23	601800	中国交建	16,365,636.67	7.82
24	600739	辽宁成大	15,899,310.11	7.59
25	000858	五粮液	15,765,997.83	7.53
26	600048	保利地产	15,647,360.20	7.47
27	600998	九州通	14,733,550.25	7.04
28	000402	金融街	14,497,670.73	6.92
29	600893	航发动力	14,212,808.18	6.79
30	000063	中兴通讯	14,085,943.02	6.73
31	600016	民生银行	13,950,261.00	6.66
32	000060	中金岭南	13,267,769.26	6.34
33	000157	中联重科	12,986,472.00	6.20
34	601788	光大证券	12,900,277.05	6.16
35	000686	东北证券	12,690,356.57	6.06
36	601225	陕西煤业	12,617,119.00	6.03
37	000156	华数传媒	12,523,871.59	5.98
38	600208	新湖中宝	12,464,530.00	5.95
39	600741	华域汽车	12,363,425.00	5.90
40	600023	浙能电力	11,895,920.00	5.68
41	600056	中国医药	11,751,606.63	5.61
42	600219	南山铝业	11,658,486.86	5.57
43	601179	中国西电	11,580,048.05	5.53
44	002203	海亮股份	11,163,546.24	5.33
45	002736	国信证券	11,058,300.70	5.28
46	002146	荣盛发展	10,978,214.39	5.24
47	600030	中信证券	10,708,760.00	5.11

48	600637	东方明珠	10,585,568.06	5.06
49	601211	国泰君安	10,353,969.64	4.94
50	000783	长江证券	10,306,187.58	4.92
51	002195	二三四五	10,297,208.76	4.92
52	000776	广发证券	10,132,591.96	4.84
53	600703	三安光电	10,126,311.68	4.84
54	600674	川投能源	10,049,127.00	4.80
55	600031	三一重工	10,015,580.87	4.78
56	600350	山东高速	9,921,209.71	4.74
57	601857	中国石油	9,861,406.00	4.71
58	300182	捷成股份	9,697,086.25	4.63
59	601688	华泰证券	9,619,106.00	4.59
60	000039	中集集团	9,578,516.89	4.57
61	600019	宝钢股份	9,556,698.16	4.56
62	603288	海天味业	9,457,705.38	4.52
63	600377	宁沪高速	9,382,381.32	4.48
64	600362	江西铜业	9,216,966.05	4.40
65	601607	上海医药	9,174,338.71	4.38
66	600028	中国石化	9,141,478.40	4.37
67	601166	兴业银行	8,982,266.00	4.29
68	601801	皖新传媒	8,767,399.61	4.19
69	600050	中国联通	8,756,673.00	4.18
70	000425	徐工机械	8,504,819.00	4.06
71	600958	东方证券	8,278,136.50	3.95
72	601567	三星医疗	7,688,416.58	3.67
73	000078	海王生物	7,473,918.00	3.57
74	601899	紫金矿业	7,472,516.00	3.57
75	601390	中国中铁	7,237,778.00	3.46
76	002416	爱施德	7,187,299.86	3.43
77	600000	浦发银行	7,136,194.34	3.41
78	601328	交通银行	7,053,695.00	3.37

79	000513	丽珠集团	6,981,985.00	3.33
80	600188	兖州煤业	6,977,088.73	3.33
81	601555	东吴证券	6,959,694.49	3.32
82	002396	星网锐捷	6,880,497.78	3.29
83	000623	吉林敖东	6,873,732.00	3.28
84	600755	厦门国贸	6,809,467.00	3.25
85	000021	深科技	6,703,162.45	3.20
86	000738	航发控制	6,618,266.30	3.16
87	600061	国投资本	6,563,869.00	3.13
88	601377	兴业证券	6,416,678.70	3.06
89	000046	泛海控股	6,398,042.82	3.06
90	600079	人福医药	6,285,188.00	3.00
91	000028	国药一致	6,268,169.04	2.99
92	000963	华东医药	6,229,178.00	2.97
93	000685	中山公用	6,184,098.00	2.95
94	601766	中国中车	6,180,863.50	2.95
95	002181	粤传媒	6,052,988.00	2.89
96	601928	凤凰传媒	6,027,836.00	2.88
97	002013	中航机电	5,986,846.00	2.86
98	002152	广电运通	5,983,481.00	2.86
99	000400	许继电气	5,954,435.58	2.84
100	002202	金风科技	5,929,466.20	2.83
101	002518	科士达	5,881,574.40	2.81
102	002001	新和成	5,801,900.00	2.77
103	002275	桂林三金	5,780,347.78	2.76
104	600018	上港集团	5,663,123.00	2.70
105	601288	农业银行	5,613,002.00	2.68
106	601669	中国电建	5,579,113.00	2.66
107	000938	紫光股份	5,553,983.66	2.65
108	600757	长江传媒	5,481,657.00	2.62
109	600409	三友化工	5,476,373.59	2.62

110	000001	平安银行	5,417,934.04	2.59
111	000732	泰禾集团	5,416,952.00	2.59
112	601169	北京银行	5,376,533.00	2.57
113	600690	青岛海尔	5,312,595.31	2.54
114	601231	环旭电子	5,156,642.95	2.46
115	300136	信维通信	5,141,802.74	2.46
116	000750	国海证券	5,082,433.50	2.43
117	002093	国脉科技	5,056,758.29	2.41
118	600383	金地集团	5,039,810.80	2.41
119	000417	合肥百货	4,894,715.73	2.34
120	000338	潍柴动力	4,887,534.25	2.33
121	600633	浙数文化	4,877,836.63	2.33
122	601958	金钼股份	4,826,452.00	2.30
123	601877	正泰电器	4,770,377.64	2.28
124	600518	康美药业	4,724,172.00	2.26
125	000883	湖北能源	4,709,067.00	2.25
126	000501	鄂武商 A	4,705,100.22	2.25
127	000895	双汇发展	4,601,060.50	2.20
128	600180	瑞茂通	4,572,328.73	2.18
129	600873	梅花生物	4,527,270.00	2.16
130	000415	渤海金控	4,496,040.00	2.15
131	002470	金正大	4,480,650.00	2.14
132	601238	广汽集团	4,451,926.00	2.13
133	600160	巨化股份	4,425,239.00	2.11
134	601989	中国重工	4,347,311.00	2.08
135	600332	白云山	4,339,405.00	2.07
136	600373	中文传媒	4,330,746.55	2.07
137	603077	和邦生物	4,231,041.00	2.02

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	601318	中国平安	27,947,425.67	13.35
2	601668	中国建筑	24,617,181.00	11.76
3	600519	贵州茅台	23,764,871.54	11.35
4	600900	长江电力	23,211,978.97	11.08
5	600999	招商证券	22,860,485.94	10.92
6	601186	中国铁建	21,222,464.71	10.13
7	600309	万华化学	19,221,369.33	9.18
8	000063	中兴通讯	18,159,675.14	8.67
9	000858	五粮液	18,070,982.55	8.63
10	600837	海通证券	17,885,995.17	8.54
11	601800	中国交建	17,576,386.92	8.39
12	000333	美的集团	15,911,143.17	7.60
13	000651	格力电器	15,737,476.30	7.52
14	000002	万科 A	15,584,579.10	7.44
15	601088	中国神华	15,260,697.04	7.29
16	601628	中国人寿	15,095,592.48	7.21
17	600023	浙能电力	14,334,307.33	6.85
18	000069	华侨城 A	14,314,090.00	6.84
19	000402	金融街	13,625,295.99	6.51
20	600585	海螺水泥	13,588,390.44	6.49
21	600048	保利地产	13,547,386.15	6.47
22	601601	中国太保	13,366,718.98	6.38
23	601225	陕西煤业	13,173,734.00	6.29
24	600998	九州通	13,067,557.30	6.24
25	600030	中信证券	12,945,520.00	6.18
26	000157	中联重科	12,883,002.00	6.15
27	600362	江西铜业	12,867,677.42	6.14
28	600741	华域汽车	12,624,785.48	6.03
29	601688	华泰证券	12,542,081.22	5.99

30	601398	工商银行	12,440,898.00	5.94
31	600208	新湖中宝	12,408,791.00	5.93
32	601607	上海医药	11,890,455.30	5.68
33	002304	洋河股份	11,748,717.80	5.61
34	601179	中国西电	11,511,467.00	5.50
35	600104	上汽集团	11,490,955.64	5.49
36	002415	海康威视	11,148,941.77	5.32
37	600028	中国石化	11,047,681.00	5.28
38	600703	三安光电	10,881,241.77	5.20
39	601211	国泰君安	10,818,467.00	5.17
40	600637	东方明珠	10,292,950.56	4.92
41	002736	国信证券	10,144,871.51	4.84
42	002146	荣盛发展	10,133,931.30	4.84
43	000725	京东方 A	10,086,699.00	4.82
44	000783	长江证券	10,085,794.00	4.82
45	600739	辽宁成大	9,890,577.19	4.72
46	600219	南山铝业	9,884,579.50	4.72
47	000776	广发证券	9,773,438.44	4.67
48	300182	捷成股份	9,708,681.50	4.64
49	603288	海天味业	9,538,655.54	4.56
50	600016	民生银行	9,419,469.00	4.50
51	601555	东吴证券	9,307,316.52	4.44
52	000156	华数传媒	9,129,935.01	4.36
53	600377	宁沪高速	8,999,389.00	4.30
54	000425	徐工机械	8,971,442.00	4.28
55	600958	东方证券	8,597,603.07	4.11
56	600893	航发动力	8,481,458.14	4.05
57	601377	兴业证券	8,424,984.08	4.02
58	601006	大秦铁路	8,338,174.72	3.98
59	601989	中国重工	8,173,238.96	3.90
60	601899	紫金矿业	7,942,157.49	3.79

61	601390	中国中铁	7,667,733.14	3.66
62	600188	兖州煤业	7,482,680.93	3.57
63	600056	中国医药	7,469,163.07	3.57
64	600031	三一重工	7,231,631.00	3.45
65	600061	国投资本	7,215,411.00	3.45
66	000938	紫光股份	7,161,489.27	3.42
67	002203	海亮股份	7,099,192.00	3.39
68	000060	中金岭南	6,950,781.74	3.32
69	002396	星网锐捷	6,815,103.95	3.25
70	601928	凤凰传媒	6,772,860.28	3.23
71	601567	三星医疗	6,750,847.19	3.22
72	000738	航发控制	6,738,960.00	3.22
73	601766	中国中车	6,736,763.00	3.22
74	002001	新和成	6,719,238.50	3.21
75	000623	吉林敖东	6,489,535.00	3.10
76	601857	中国石油	6,453,346.00	3.08
77	600373	中文传媒	6,379,546.00	3.05
78	000686	东北证券	6,326,707.83	3.02
79	000028	国药一致	6,300,142.75	3.01
80	000685	中山公用	6,238,766.00	2.98
81	600018	上港集团	6,113,751.00	2.92
82	000046	泛海控股	6,110,811.70	2.92
83	002152	广电运通	6,060,578.50	2.89
84	601788	光大证券	5,993,891.99	2.86
85	600350	山东高速	5,977,906.60	2.85
86	600383	金地集团	5,950,447.29	2.84
87	002202	金风科技	5,911,956.00	2.82
88	600690	青岛海尔	5,854,773.00	2.80
89	002181	粤传媒	5,784,525.48	2.76
90	600873	梅花生物	5,784,015.00	2.76
91	600674	川投能源	5,719,687.00	2.73

92	000078	海王生物	5,616,835.00	2.68
93	000732	泰禾集团	5,486,184.24	2.62
94	601231	环旭电子	5,461,508.09	2.61
95	002195	二三四五	5,449,733.00	2.60
96	600409	三友化工	5,434,055.70	2.59
97	300136	信维通信	5,349,108.61	2.55
98	000021	深科技	5,319,719.99	2.54
99	601669	中国电建	5,279,992.00	2.52
100	600019	宝钢股份	5,278,416.11	2.52
101	600518	康美药业	5,258,455.00	2.51
102	600757	长江传媒	5,213,329.62	2.49
103	000750	国海证券	5,130,108.55	2.45
104	002013	中航机电	5,127,944.00	2.45
105	002275	桂林三金	5,051,949.00	2.41
106	000415	渤海金控	5,042,601.00	2.41
107	002027	分众传媒	5,013,074.20	2.39
108	601166	兴业银行	4,976,261.00	2.38
109	000417	合肥百货	4,959,103.92	2.37
110	600887	伊利股份	4,946,490.88	2.36
111	000039	中集集团	4,923,979.87	2.35
112	002093	国脉科技	4,876,155.62	2.33
113	000501	鄂武商 A	4,774,529.06	2.28
114	000963	华东医药	4,713,679.12	2.25
115	601111	中国国航	4,686,947.38	2.24
116	000883	湖北能源	4,655,290.00	2.22
117	600180	瑞茂通	4,651,904.72	2.22
118	601958	金钼股份	4,649,398.50	2.22
119	000400	许继电气	4,648,342.74	2.22
120	002518	科士达	4,508,794.59	2.15
121	601238	广汽集团	4,371,486.47	2.09
122	601877	正泰电器	4,356,017.00	2.08

123	000898	鞍钢股份	4,342,074.00	2.07
124	603077	和邦生物	4,327,314.00	2.07
125	601288	农业银行	4,308,215.00	2.06
126	601898	中煤能源	4,306,587.33	2.06
127	601939	建设银行	4,258,945.00	2.03
128	601098	中南传媒	4,241,695.30	2.03
129	000999	华润三九	4,234,585.00	2.02
130	600332	白云山	4,178,860.00	2.00

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	1,922,109,806.46
卖出股票收入(成交)总额	1,725,350,089.68

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	24,573,364.50	5.02
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)	741,127.70	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,314,492.20	5.17

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	019540	16国债12	202,200	20,098,680.00	4.11
2	019579	17国债24	44,850	4,474,684.50	0.91
3	132013	17宝武EB	6,510	633,227.70	0.13
4	128024	宁行转债	1,079	107,900.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	44,556.59
2	应收证券清算款	293,373.42
3	应收股利	-
4	应收利息	361,571.61

5	应收申购款	114,371.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	813,873.08

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
创金 合信 沪深3 00增 强A	404	541,721.43	213,926,231.1 7	97.7 5%	4,929,226.09	2.25%
创金 合信 沪深3	576	428,843.36	243,704,152.6 1	98.6 6%	3,309,623.21	1.34%

00增 强C						
合计	946	492,462.19	457,630,383.7 8	98.2 3%	8,238,849.30	1.77%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	创金合信沪深300 增强A	16,655.52	0.0100%
	创金合信沪深300 增强C	31,957.65	0.0100%
	合计	48,613.17	0.0100%

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	创金合信沪深300 增强A	0
	创金合信沪深300 增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	创金合信沪深300 增强A	0
	创金合信沪深300 增强C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例 (%)	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例 (%)	发 起 份 额 承

					诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	2.15	10,000,000.00	2.15	36月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	2.15	10,000,000.00	2.15	36月

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信沪深300增强A	创金合信沪深300增强C
基金合同生效日(2015年12月31日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	214,235,996.89	5,424,948.88
本报告期基金总申购份额	6,065,981.13	300,463,636.91
减：本报告期基金总赎回份额	1,446,520.76	58,874,809.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	218,855,457.26	247,013,775.82

§ 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

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所,本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用30,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	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	
光大证券	2	1,511,139,354.46	41.51%	733,598.06	51.59%	-
第一创业证券	2	2,129,441,207.89	58.49%	688,256.82	48.41%	-

注:交易单元的选择标准和程序:

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

(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

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

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

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

本基金本报告期内无交易单元变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	29,876,640.77	100.00%	1,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

§ 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	20170101-20171231	166,822,020.64	0.00	0.00	166,822,020.64	35.81%
	2	20171222-20171231	0.00	236,527,215.31	0.00	236,527,215.31	50.77%

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

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年三月三十一日