

# 创金合信鑫安保本混合型证券投资基金

## 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:中国工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。

基金托管人中国工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	创金合信鑫安保本混合	
基金主代码	002565	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年05月11日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	757,394,304.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信鑫安保本混合A	创金合信鑫安保本混合C
下属分级基金的交易代码	002565	002566
报告期末下属分级基金的份额总额	574,654,005.35份	182,740,299.20份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用投资组合保险技术控制本金损失的风险，并力争实现基金资产的稳健增值。
------	--

投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，即CPPI策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。
业绩比较基准	两年期人民币定期存款利率（税后）+1% 上述“两年期人民币定期存款利率（税后）”指当期保本周期起始日（若为第一个保本周期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的两年期金融机构人民币存款基准税后利率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95588
传真	0755-25832571	010-66105798

### 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5月11日（基金合同生效日）-2016年12月31日	
	创金合信鑫安保本混合A	创金合信鑫安保本混合C	创金合信鑫安保本混合A	创金合信鑫安保本混合C
本期已实现收益	-1,138,676.66	-1,425,067.08	44,500,073.09	10,919,161.13
本期利润	12,843,304.57	3,123,730.47	29,001,371.38	6,788,160.97
加权平均基金份额本期利润	0.0191	0.0143	0.0300	0.0256
本期基金份额净值增长率	2.04%	1.46%	3.00%	2.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0476	0.0374	0.0297	0.0247
期末基金资产净值	603,726,070.42	190,123,151.77	803,433,315.59	259,298,983.14
期末基金份额净值	1.051	1.040	1.030	1.025

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. 本基金合同生效日为2016年5月11日，上年度可比期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

#### 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

创金合信鑫安保本混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	0.13%	0.78%	0.01%	-0.40%	0.12%
过去六个月	1.64%	0.12%	1.56%	0.01%	0.08%	0.11%
过去一年	2.04%	0.12%	3.10%	0.01%	-1.06%	0.11%
自基金合同生效起至今	5.10%	0.14%	5.09%	0.01%	0.01%	0.13%

## 创金合信鑫安保本混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.19%	0.12%	0.78%	0.01%	-0.59%	0.11%
过去六个月	1.27%	0.11%	1.56%	0.01%	-0.29%	0.10%
过去一年	1.46%	0.12%	3.10%	0.01%	-1.64%	0.11%
自基金合同生效起至今	4.00%	0.14%	5.09%	0.01%	-1.09%	0.13%

### 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

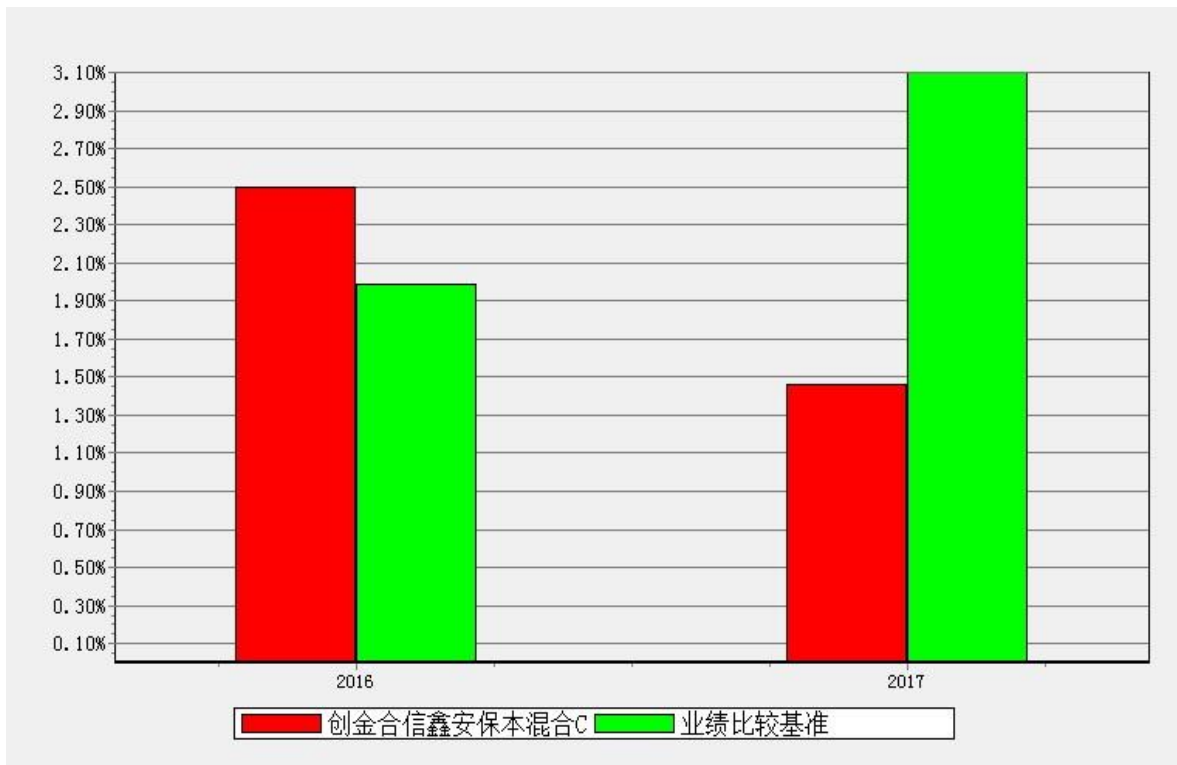
创金合鑫鑫安保本混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年05月11日-2017年12月31日)



创金合鑫鑫安保本混合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05月11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

本基金自基金合同生效日(2016年5月11日)至本报告期末未发生利润分配。

## § 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		
王一兵	本基金经理、固定收益部总监	2016-05-11	-	13年	王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业，作为公司上市代表任海南中商期货交易所红马甲。1997年进入股票市场，经历了各种证券市场的大幅涨跌变化，拥有成熟的投资心态和丰富的投资经验。曾历任第一创业证券固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人。熟悉债券市场和固定收益产品的各种投资技巧，尤其精通近两年发展迅速的信用债，对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。
程志田	本基金经	2016-05-	-	11年	程志田先生，中国国籍，金融



	理、量化 投资部总 监	11			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。
--	-------------------	----	--	--	--

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，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16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

本基金延续采用恒定比例组合保险策略

(Constant Proportion Portfolio Insurance, 即CPPI策略)。主要通过数量分析, 根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数(即风险乘数), 动态调整安全资产与风险资产的投资比例, 以力争实现基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值, 从而实现投资组合的保本增值目标。在CPPI策略的大框架下, 2017年产品基于金融防风险、去杠杆的大背景判断, 在债券投资上持续维持短久期、高评级、低杠杆的防御型投资策略, 在防范风险的同时追求产品净值的稳定增长; 在权益投资上, 基于周期向上与供给侧改革的大背景, 产品以大盘股为主要配置对象, 在控制产品回撤的基础上, 积极参与权益的投资机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鑫安保本混合A基金份额净值为1.051元;本报告期内, 基金份额净值增长率为2.04%, 同期业绩比较基准收益率为3.1%;截至报告期末创金合信鑫安保本混合C基金份额净值为1.040元;本报告期内, 基金份额净值增长率为1.46%, 同期业绩比较基准收益率为3.1%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年利率债缺乏趋势性机会。一方面, 虽然经济平稳可能略降, 但经济韧性仍强, 结构持续改善, 货币政策整体难宽松, 严监管还将持续; 另一方面, 银行资产负债扩张将继续放缓, 债市配置力量预计维持较弱。2017年对同业理财的治理导致债市的大幅调整, 2018年对银行理财的治理将成为债市的主要风险来源。而信用债方面, 在资本利得机会不大的环境下, 票息策略仍将是主要策略。当前债市收益率绝对水平处于历史较高位置, 曲线期限利差较窄, 短期债券的配置价值较高。经济总体偏稳下, 伴随企业盈利的整体改善, 信用出现系统性违约风险的概率较低, 不过在银行信用扩张放缓阶段, 弱资质民企获取流动性能力下降, 发生信用风险的可能性加大。因此, 综合来看, 2018年债市投资选择上需要严格控制久期, 不宜明显拉长, 信用下沉程度要有所控制。

权益方面, 旧经济市场出清, 供给侧改革推进, 新兴经济活跃, 盈利具备持续转好

基础；利率上行尚未明显损害经济，监管冲击未明显冲击风险情绪。市场短期回调震荡，结构分化特征将依旧存在。大盘股将继续受益于不高的估值和较确定的盈利增长，尤其是经济转型过程中龙头的优势提升；小盘股在偏高估值下，对利率上行和监管冲击的反应较为敏感，可能将继续底部震荡；关注中盘蓝筹机会。未来继续关注可中期战略配置的板块，如银行、消费、新能源车等。同时周期行业受益于供求出清，盈利改善有持续性，看好钢铁、煤炭等周期股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对创金合信鑫安保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，创金合信鑫安保本混合型证券投资基金的管理人—创金合信基金管理有限公司在创金合信鑫安保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信鑫安保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信鑫安保本混合型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：创金合信鑫安保本混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7,895,723.62	20,019,737.05
结算备付金	2,981,431.10	5,206,255.03
存出保证金	70,718.22	81,998.38
交易性金融资产	883,344,816.74	1,686,427,337.09
其中：股票投资	115,095,471.64	196,884,565.49
基金投资	-	-
债券投资	768,249,345.10	1,489,542,771.60
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	69,468,464.21	-

应收证券清算款	-	1,210,191.08
应收利息	14,483,111.15	24,588,153.99
应收股利	-	-
应收申购款	1,428.56	629.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	978,245,693.60	1,737,534,301.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> 2017年12月31日	<b>上年度末</b> 2016年12月31日
<b>负 债:</b>		
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	181,714,827.50	671,808,857.28
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,117,619.52	249,013.77
应付管理人报酬	818,984.42	1,228,310.00
应付托管费	136,497.40	204,718.33
应付销售服务费	131,691.62	177,116.60
应付交易费用	43,636.66	438,231.83
应交税费	-	-
应付利息	224,136.45	504,943.71
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	209,077.84	190,811.44
负债合计	184,396,471.41	674,802,002.96
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	757,394,304.55	1,033,305,351.73
未分配利润	36,454,917.64	29,426,947.00
所有者权益合计	793,849,222.19	1,062,732,298.73
负债和所有者权益总计	978,245,693.60	1,737,534,301.69

注：1. 报告截止日2017年12月31日，基金份额总额757,394,304.55份，其中A类基金份额的份额总额为574,654,005.35份，份额净值1.051元；C类基金份额的份额总额为182,740,299.20份，份额净值1.04元。

2. 本基金合同生效日为2016年5月11日，上年度可比期间为2016年5月11日至2016年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫安保本混合型证券投资基金

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05月11日（基金合 同生效日）至2016年12月3 1日
一、收入	43,940,572.00	55,390,312.23
1. 利息收入	39,463,444.81	28,605,936.32
其中：存款利息收入	297,456.06	643,050.79
债券利息收入	38,816,003.65	27,543,619.74
资产支持证券利息 收入	-	-
买入返售金融资产 收入	349,985.10	419,265.79
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）	-15,655,448.32	44,497,532.13
其中：股票投资收益	-3,052,332.95	36,421,240.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-14,140,614.94	7,832,210.53
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	1,537,499.57	244,081.25
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	18,530,778.78	-19,629,701.87
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	1,601,796.73	1,916,545.65
<b>减：二、费用</b>	<b>27,973,536.96</b>	<b>19,600,779.88</b>
1. 管理人报酬	11,080,898.75	9,680,601.54
2. 托管费	1,846,816.33	1,613,433.55
3. 销售服务费	1,798,153.70	1,387,375.95
4. 交易费用	2,045,880.98	1,758,383.87
5. 利息支出	10,951,390.29	4,951,283.80
其中：卖出回购金融资产支出	10,951,390.29	4,951,283.80
6. 其他费用	250,396.91	209,701.17
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>15,967,035.04</b>	<b>35,789,532.35</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>15,967,035.04</b>	<b>35,789,532.35</b>

注：本基金合同生效日为2016年5月11日，上年度可比期间为2016年5月11日至2016年12月31日。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：创金合信鑫安保本混合型证券投资基金

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)	1,033,305,351.73	29,426,947.00	1,062,732,298.73
二、本期经营活动产生的基金	-	15,967,035.04	15,967,035.04



净值变动数(本期利润)			
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)	-275,911,047.18	-8,939,064.40	-284,850,111.58
其中：1. 基金申购款	1,291,587.27	35,885.32	1,327,472.59
2. 基金赎回款	-277,202,634.45	-8,974,949.72	-286,177,584.17
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)	757,394,304.55	36,454,917.64	793,849,222.19
项 目	上年度可比期间 2016年05月11日(基金合同生效日)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)	1,265,842,004.20	-	1,265,842,004.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,789,532.35	35,789,532.35
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)	-232,536,652.47	-6,362,585.35	-238,899,237.82
其中：1. 基金申购款	10,189,509.88	263,107.19	10,452,617.07
2. 基金赎回款	-242,726,162.35	-6,625,692.54	-249,351,854.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,033,305,351.73	29,426,947.00	1,062,732,298.73

注：本基金合同生效日为2016年5月11日，上年度可比期间为2016年5月11日至2016年12月31日。

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

创金合信鑫安保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]488号《关于准予创金合信鑫安保本混合型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《创金合信鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,265,284,467.96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478号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年5月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,265,842,004.20份基金份额,其中认购资金利息折合557,536.24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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、各类债券(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、可交换债券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:两年期人民币定期存款利率(税后)+1%。

于2017年12月31日,本基金的保本期安排列示如下:

保本期到期日2018年5月11日,份额数753,325,749.25,最大保本线1.000,截止2017年12月31日基金份额净值1.048。

### 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》、《创金合信鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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12月31日		上年度可比期间 2016年05月11日(基金合同生 效日)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	2,152,978.41	0.13%	-	-

##### 7.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 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	1,574.47	0.16%	645.74	2.11%
关联方名称	上年度可比期间 2016年05月11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

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05月11日(基金合同 生效日)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	450,540,797.92	39.15%	-	-

#### 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05月11日(基金合同 生效日)至2016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	3,787,300,000.00	18.26%	-	-

#### 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05月11日（基金合同 生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,080,898.75	9,680,601.54
其中：支付销售机构的客户维护费	5,201,324.55	5,342,145.20

##### 1、基金管理人的管理费

在保本周期内，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。本基金在到期操作期（除保本周期到期日）和过渡期内不收取管理费。

##### 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05月11日（基金合同生 效日）至2016年12月31日
----	---------------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	1,846,816.33	1,613,433.55
----------------	--------------	--------------

在保本周期内，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。本基金在到期操作期（除保本周期到期日）和过渡期内不收取托管费。

#### 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		
	创金合信鑫安保本混合A	创金合信鑫安保本混合C	合计
中国工商银行	-	1,479,377.20	1,479,377.20
合计	-	1,479,377.20	1,479,377.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年05月11日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信鑫安保本混合A	创金合信鑫安保本混合C	合计
中国工商银行	-	1,121,680.34	1,121,680.34
合计	-	1,121,680.34	1,121,680.34

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0.8%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× 0.8%/ 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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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2 017年12月31日		上年度可比期间 2016年05月11日（基金合同生效 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
中国工商银行股份有限公司	7,895,7 23.62	126,33 8.56	20,019,737.05	370,393.58

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 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
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	新发流通受限	11.06	53.21	345	3,815.70	18,357.45	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新发流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项停牌	8.49	-	-	60,200	611,241.51	511,098.00	-
600146	商赢环球	2017-09-05	重大事项停牌	25.42	2018-01-16	22.88	18,900	648,376.00	480,438.00	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	5,300	185,447.00	201,082.00	-
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项停牌	6.67	2018-02-26	7.28	25,700	157,027.00	171,419.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	11,000	92,510.00	80,850.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大事项停牌	32.14	2018-01-08	30.15	2,200	59,334.00	70,708.00	-
600	永泰	2017-	重大事项	3.3	-	-	19,500	73,16	65,52	-

157	能源	11-21	项停牌	6				6.00	0.00	
600 150	中国 船舶	2017- 09-27	重大事 项停牌	24. 67	2018- 03-21	22. 20	2,600	60,49 3.00	64,14 2.00	-
601 216	君正 集团	2017- 12-15	重大事 项停牌	4.7 1	-	-	13,200	71,14 8.00	62,17 2.00	-
002 470	金正 大	2017- 10-25	重大事 项停牌	9.1 5	2018- 02-09	8.2 4	6,100	49,29 6.00	55,81 5.00	-
600 685	中船 防务	2017- 09-27	重大事 项停牌	26. 66	2018- 03-21	24. 05	1,200	31,03 2.00	31,99 2.00	-
000 156	华数 传媒	2017- 12-26	重大事 项停牌	11. 40	-	-	2,200	32,18 6.00	25,08 0.00	-

#### 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 34,999,827.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总 额
101374003	13北控集MT N001	2018-01-02	100.35	350,000	35,122,50 0.00
合计				0.00	0.00

##### 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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额146,715,000.00元，于2018年1月2日和2018年1月4日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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113,695,053.44元,属于第二层次的余额为769,649,763.30元,无属于第三层次的余额(2016年12月31日:第一层次180,497,279.16元,第二层次1,505,930,057.93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

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	115,095,471.64	11.77
	其中：股票	115,095,471.64	11.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	768,249,345.10	78.53
	其中：债券	768,249,345.10	78.53
	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	69,468,464.21	7.10
	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	10,877,154.72	1.11
8	其他各项资产	14,555,257.93	1.49
9	合计	978,245,693.60	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	127,053.00	0.02
B	采矿业	4,609,008.00	0.58
C	制造业	41,275,625.59	5.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,862,530.20	0.23
E	建筑业	5,653,799.00	0.71

F	批发和零售业	2,488,809.20	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	5,641,645.11	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,901,305.34	0.24
J	金融业	43,173,318.20	5.44
K	房地产业	7,106,344.00	0.90
L	租赁和商务服务业	401,440.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	301,513.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	102,789.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	347,383.00	0.04
S	综合	102,909.00	0.01
	合计	115,095,471.64	14.50

### 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

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	601318	中国平安	65,000	4,548,700.00	0.57
2	600519	贵州茅台	4,400	3,068,956.00	0.39
3	601766	中国中车	230,915	2,796,380.65	0.35
4	600036	招商银行	89,100	2,585,682.00	0.33
5	600887	伊利股份	76,000	2,446,440.00	0.31
6	600019	宝钢股份	234,577	2,026,745.28	0.26
7	600048	保利地产	138,800	1,964,020.00	0.25

				0	
8	601166	兴业银行	114,300	1,941,957.00	0.24
9	600016	民生银行	224,700	1,885,233.00	0.24
10	601601	中国太保	45,000	1,863,900.00	0.23

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](http://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	601318	中国平安	14,220,039.00	1.34
2	601668	中国建筑	11,521,840.66	1.08
3	601628	中国人寿	9,167,658.21	0.86
4	600900	长江电力	8,493,617.00	0.80
5	600519	贵州茅台	7,747,235.00	0.73
6	600030	中信证券	7,743,996.00	0.73
7	600104	上汽集团	7,166,339.37	0.67
8	000651	格力电器	6,920,379.00	0.65
9	600036	招商银行	6,918,891.87	0.65
10	601857	中国石油	6,046,268.00	0.57
11	601601	中国太保	5,879,188.00	0.55
12	601166	兴业银行	5,764,658.00	0.54
13	600837	海通证券	5,640,280.91	0.53
14	600016	民生银行	5,616,886.82	0.53
15	000725	京东方 A	5,536,832.00	0.52
16	601288	农业银行	5,506,383.00	0.52
17	601989	中国重工	5,445,362.00	0.51

18	000776	广发证券	5,434,708.00	0.51
19	600999	招商证券	5,248,876.00	0.49
20	600383	金地集团	4,947,695.00	0.47

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	11,312,740.07	1.06
2	601668	中国建筑	9,965,754.00	0.94
3	600900	长江电力	8,228,387.00	0.77
4	601628	中国人寿	8,028,990.20	0.76
5	000651	格力电器	6,326,285.00	0.60
6	600030	中信证券	6,119,915.00	0.58
7	600519	贵州茅台	6,007,480.00	0.57
8	600104	上汽集团	5,790,348.37	0.54
9	000725	京东方A	5,274,206.00	0.50
10	601989	中国重工	5,114,226.00	0.48
11	000776	广发证券	5,036,817.00	0.47
12	601601	中国太保	5,032,635.14	0.47
13	002736	国信证券	5,026,833.00	0.47
14	600036	招商银行	4,879,438.00	0.46
15	601088	中国神华	4,829,791.00	0.45
16	600383	金地集团	4,792,453.03	0.45
17	601857	中国石油	4,763,703.00	0.45
18	600585	海螺水泥	4,487,722.00	0.42
19	603567	珍宝岛	4,390,454.04	0.41
20	601567	三星医疗	4,264,928.87	0.40

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	794,735,588.31
卖出股票收入（成交）总额	883,397,932.43

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,976,000.00	5.04
	其中：政策性金融债	39,976,000.00	5.04
4	企业债券	205,421,297.50	25.88
5	企业短期融资券	291,526,800.00	36.72
6	中期票据	190,341,000.00	23.98
7	可转债(可交换债)	31,102,747.60	3.92
8	同业存单	9,881,500.00	1.24
9	其他	-	-
10	合计	768,249,345.10	96.78

### 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	101374003	13北控集MTN001	600,000	60,210,000.00	7.58
2	101559018	15南瑞MTN001	500,000	50,125,000.00	6.31
3	011754115	17澜沧江SCP006	500,000	50,000,000.00	6.30
4	136427	16葛洲02	500,000	48,745,000.00	6.14
5	112318	16白药01	500,000	48,725,000.00	6.14

### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2017年5月5日，西南证券股份有限公司（下称“西南证券”，股票代码：600369）及河南大有能源股份有限公司（以下简称大有能源）2012年非公开发行股票项目及持续督导保荐代表人李阳、吕德富、梁俊收到《中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]46号，以下简称《行政处罚事先告知书》），告知书主要内容为：一、对西南证券的违法行为责令改正，给予警告，没收业务收入1,000万元，并处以2,000万元罚款；二、对直接负责的主管人员李阳、吕德富给予警告，并分别处以30万元罚款；三、对直接负责的主管人员梁俊给予警告，并处以15万元罚款。；

2017年5月9日，西南证券股份有限公司（下称“西南证券”，股票代码：600369）及鞍山重型矿山机器股份有限公司（以下简称鞍重股份）2016年重大资产重组财务顾问主办人童星、朱正贵收到中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《行政处罚事先告知书》（处罚字（2017）48号），主要内容为：一、责令西南证券改正违法行为，没收业务收入100万元，并处罚款500万元；二、对童星、朱正贵分别给予警告，并分别处以10万元罚款。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，西南证券股份有限公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改。该事件发生后该公司经营状况正常，2017年前三季度净利润达6亿元，并未对西南证券业绩造成重大影响。该公司作为西南地区龙头券商之一，在西南区域业务覆盖面广而深，未来整体业务稳定性有一定的保障，同时西南证券整体负债率处于同行业的中下水平，整体资产质量较高，信用风险极低，因此维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对债券14西南01，债券代码122379.SH进行了投资。

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	70,718.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,483,111.15
5	应收申购款	1,428.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,555,257.93

## 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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	4,020	142,948.76	-	-	574,654,005.3 5	100.0 0%

鑫安 保本 混合A						
创金 合信 鑫安 保本 混合C	1,613	113,292.19	-	-	182,740,299.2 0	100.0 0%
合计	5,610	135,007.90	-	-	757,394,304.5 5	100.0 0%

## 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	创金合信鑫安保 本混合A	232,253.24	0.0400%
	创金合信鑫安保 本混合C	21,001.94	0.0100%
	合计	253,255.18	0.0300%

## 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	创金合信鑫安保本 混合A	0~10
	创金合信鑫安保本 混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	创金合信鑫安保本 混合A	0
	创金合信鑫安保本 混合C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信鑫安保本混合 A	创金合信鑫安保本混合 C
基金合同生效日(2016年05月11日)基金份额总额	992,436,361.71	273,405,642.49
本报告期期初基金份额总额	780,257,561.36	253,047,790.37
本报告期基金总申购份额	545,681.92	745,905.35
减：本报告期基金总赎回份额	206,149,237.93	71,053,396.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	574,654,005.35	182,740,299.20

## § 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100,000.00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	佣金	占当期	

			股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
东兴证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	401,151,316.18	23.99%	88,396.98	8.95%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	2,152,978.41	0.13%	1,574.47	0.16%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	146,151,550.98	8.74%	106,882.04	10.82%	-
中泰证券	2	517,928,978.20	30.98%	374,224.11	37.87%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	2,242,192.00	0.13%	1,617.10	0.16%	-
东吴证券	2	1,425,264.19	0.09%	1,042.25	0.11%	-
招商证券	2	559,237,240.30	33.45%	404,845.22	40.97%	-
长江证券	2	40,691,374.27	2.43%	9,166.12	0.93%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	4	1,010,943.22	0.06%	436.00	0.04%	-

中信证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内新增银河证券、光大证券、东吴证券、中信证券、长江证券、天风证券、国泰君安、安信证券、太平洋证券、兴业证券、平安证券、广发证券、申万宏源、西藏东方财富证券、华泰证券、中投证券、广州证券18家券商的36个交易单元。

### 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
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	167,215,113.98	14.53%	2,300,100.00	11.09%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-

第一创业证券	450,540,797.92	39.15%	3,787,300.00	18.26%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	25,951,688.60	2.26%	2,789,200.00	13.45%	-	-	-	-
中泰证券	15,545,763.80	1.35%	2,477,200.00	11.94%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	26,301,050.55	2.29%	178,715,000.00	0.86%	-	-	-	-
东吴证券	20,792,433.00	1.81%	192,500,000.00	0.93%	-	-	-	-
招商证券	159,935,009.39	13.90%	3,512,394,000.00	16.93%	-	-	-	-
长江证券	282,	24.59%	3,73	17.99%	-	-	-	-

	897, 821. 11		0, 50 0, 00 0. 00					
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	3, 03 1. 41	0. 00%	1, 13 1, 39 5, 00 0. 00	5. 45%	-	-	-	-
安信证券	1, 50 9, 48 8. 38	0. 13%	642, 800, 000. 00	3. 10%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## § 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

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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