
创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年02月07日起至2018年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息	72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数	
基金主代码	005567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	95,831,046.44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MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567	005568
报告期末下属分级基金的份额总额	77,595,839.80份	18,235,206.64份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。
业绩比较基准	MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-868-0666	95555	
传真	0755-25832571	0755-83195201	
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
办公地址	深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
邮政编码	518000	518040	
法定代表人	刘学民	李建红	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年02月07日(基金合同生效日)-2018年06月30日)	
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
本期已实现收益	339,169.91	67,229.14
本期利润	-7,644,334.25	-1,740,262.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1089	-0.1107
本期加权平均净值利润率	-11.13%	-11.33%
本期基金份额净值增长率	-9.54%	-9.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-7,402,127.14	-1,753,057.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0954	-0.0961
期末基金资产净值	70,193,712.66	16,482,149.48
期末基金份额净值	0.9046	0.9039
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.54%	-9.61%

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。

4. 本基金合同生效日为2018年2月7日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期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

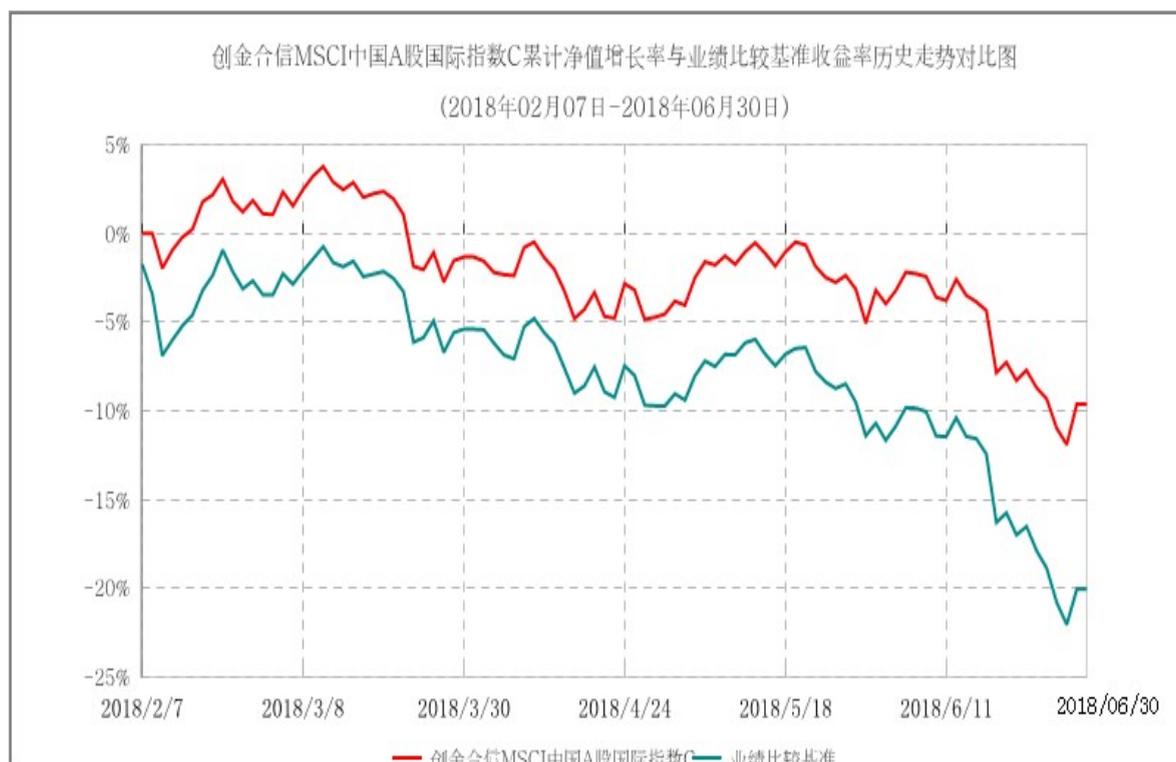
创金合信MSCI中国A股国际指数A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一 个月	-6.62%	1.28%	-10.46%	1.50%	3.84%	-0.22%
过去三 个月	-8.36%	1.08%	-15.49%	1.19%	7.13%	-0.11%
自基金 合同生 效起至 今	-9.54%	1.05%	-20.04%	1.19%	10.50%	-0.14%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一 个月	-6.63%	1.28%	-10.46%	1.50%	3.83%	-0.22%
过去三 个月	-8.40%	1.08%	-15.49%	1.19%	7.09%	-0.11%
自基金 合同生 效起至 今	-9.61%	1.05%	-20.04%	1.19%	10.43%	-0.14%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月2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11只公募基金。截至2018年6月30日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约147.33亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	10年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，负责股票现货、股指期货及其他金融衍生产品的研究开发和交易管理等工作。2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，负责证券指数化投资策略及产品的研究分析工作，现任指数策略投资研究部副总监、基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；
2、证券从业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。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数，业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的，考虑了境外投资者投资A股的相关限制（外资投资比例）和流动性因素（换手率等指标），入选的样本股主要为大中盘股票。当前最新成分股419只，其中大盘股226只，权重占比约80%，中盘股193只，权重占比约20%，所有成分股总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为55%。MSCI首次纳入A股的成分股即为该指数中的大盘股。本基金的投资策略，正常情况下主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有

效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

2018年上半年，受金融去杠杆政策、资管新规出台、美元加息周期、中美贸易争端、潜在CDR发行等因素影响，中国A股市场整体呈现连续下跌走势。本基金主要跟踪MSCI中国A股国际指数走势，净值相应出现一定幅度的下跌。从估值角度来看，经过此轮下跌周期，A股配置的吸引力逐渐提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为0.9046元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.54%，同期业绩比较基准收益率为-20.04%；截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为0.9039元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.61%，同期业绩比较基准收益率为-20.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中国外部环境来看，美元加息稳步推进，中美贸易争端进入互征关税的实质阶段，且有进一步加剧的风险；从内部环境来看，在防风险去杠杆的大背景下，经济活动部门流动性紧张局面仍将持续一段时间，因此内外部环境均对宏观经济增长构成一定压力，但压力也是动力，将加速中国经济结构调整和升级的步伐。证券市场方面，资管新规落地，金融行业进入逐步整改调整阶段，在业务、资金收缩的同时，系统性风险压力也进一步释放；同时，伴随着MSCI正式将A股纳入其国际指数体系，国际投资者将进一步增加A股配置资金。A股市场经过前期下跌后，未来估值吸引力逐渐提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，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遵规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	1,306,591.56
结算备付金		192,970.74
存出保证金		177,838.95
交易性金融资产	6.4.7.2	85,110,620.50
其中：股票投资		81,095,420.50
基金投资		-

债券投资		4,015,200.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	35,954.82
应收股利		-
应收申购款		65,016.43
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		86,888,993.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		60,835.47
应付管理人报酬		37,306.98
应付托管费		7,461.40
应付销售服务费		2,814.53
应付交易费用	6.4.7.7	8,545.50
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	96,166.98
负债合计		213,130.86

所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	95,831,046.44
未分配利润	6.4.7.10	-9,155,184.30
所有者权益合计		86,675,862.14
负债和所有者权益总计		86,888,993.00

注：1. 报告截止日2018年6月30日，基金份额总额95,831,046.44份，其中下属A类基金份额77,595,839.80份，C类基金份额18,235,206.64份。下属A类基金份额净值0.9046元，C类基金份额净值0.9039元。

2. 本基金合同生效日为2018年2月7日，2018年半年度实际报告期间为2018年2月7日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入		-8,998,994.08
1. 利息收入		48,279.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,156.66
债券利息收入		18,123.29
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		710,548.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-165,876.58
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	876,424.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-9,790,995.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	33,173.63
减：二、费用		385,602.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	163,601.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,720.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,949.98
4. 交易费用	6.4.7.18	79,095.54
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	98,234.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,384,596.61
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,384,596.61

注：本财务报表的实际报告期间为2018年2月7日（基金合同生效日）至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	68,378,462.98	-	68,378,462.98

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,384,596.61	-9,384,596.61
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)	27,452,583.46	229,412.31	27,681,995.77
其中：1. 基金申购款	37,033,930.70	274.10	37,034,204.80
2. 基金赎回款	-9,581,347.24	229,138.21	-9,352,209.03
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)	95,831,046.44	-9,155,184.30	86,675,862.14

注：本财务报表的实际报告期间为2018年2月7日(基金合同生效日)至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2442号《关于准予创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数

发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币68,365,796.39元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为68,378,462.98份基金份额，其中认购资金利息折合12,666.59份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数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标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权)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：MSCI中国A股国际指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2018年2月7日(基金合同生效日)至2018年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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(主要为权证投资)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中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中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、买入返售金融资产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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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(主要为权证投资)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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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确认。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。

6.4.4.8 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确认,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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相应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、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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和债券，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央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	1,306,591.56
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	1,306,591.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	90,811,941.76	81,095,420.50	-9,716,521.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	4,011,194.40	4,015,200.00	4,005.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,011,194.40	4,015,200.00	4,005.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	94,823,136.16	85,110,620.50	-9,712,515.66	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30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	1,032,840.00	-	-	-
一指期货	1,032,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,032,840.00	-	-	-

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投资产生的持仓损益，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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	242.67
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	76.64
应收债券利息	35,625.21
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.30
合计	35,954.82

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	8,545.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,545.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.95
预提费用	96,108.03
合计	96,166.98

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数A)	本期2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06 月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	55,960,583.31	55,960,583.31
本期申购	27,947,204.92	27,947,204.92
本期赎回(以“-”号填列)	-6,311,948.43	-6,311,948.43
本期末	77,595,839.80	77,595,839.80

6.4.7.9.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数C)	本期2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06 月30日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	12,417,879.67	12,417,879.67
本期申购	9,086,725.78	9,086,725.78
本期赎回（以“-”号填列）	-3,269,398.81	-3,269,398.81
本期末	18,235,206.64	18,235,206.64

注:1、申购含红利再投、转换入份(金)额,赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自2018年1月9日至2018年1月31日止期间公开发售,共募集有效净认购资金68,365,796.39元,其中A类基金募集有效净认购资金为55,950,031.83元,C类基金募集有效净认购资金为12,415,764.56元。根据《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入12,666.59元,在本基金成立后,折算为12,666.59的基金份额,划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

单位:人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	339,169.91	-7,983,504.16	-7,644,334.25
本期基金份额交易产生的变动数	-35,628.42	277,835.53	242,207.11
其中:基金申购款	-41,795.00	127,301.89	85,506.89
基金赎回款	6,166.58	150,533.64	156,700.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	303,541.49	-7,705,668.63	-7,402,127.14

6.4.7.10.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

单位:人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	67,229.14	-1,807,491.50	-1,740,262.36
本期基金份额交易产生的变动数	-10,663.04	-2,131.76	-12,794.80
其中：基金申购款	-15,783.04	-69,449.75	-85,232.79
基金赎回款	5,120.00	67,317.99	72,437.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,566.10	-1,809,623.26	-1,753,057.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
活期存款利息收入	28,264.82
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	1,777.05
其他	114.79
合计	30,156.66

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
卖出股票成交总额	2,820,002.00
减：卖出股票成本总额	2,985,878.58
买卖股票差价收入	-165,876.58

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	876,424.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	876,424.58

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-9,712,515.66
——股票投资	-9,716,521.26
——债券投资	4,005.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-78,480.00
——权证投资	-
——期货投资	-78,480.00
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	-9,790,995.66

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金赎回费收入	33,173.63
合计	33,173.63

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
交易所市场交易费用	79,067.70
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	27.84
合计	79,095.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
审计费用	15,366.24
信息披露费	70,243.20
汇划手续费	1,726.93
账户维护费	400.00
指数使用费	10,498.59
合计	98,234.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	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	88,882,277.34	92.01%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	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	3,010,194.40	75.04%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日			占期末应付佣金总额的比例
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	
第一创业证券股份有限公司	64,399.83	95.16%	5,270.52	61.68%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	163,601.72
其中：支付销售机构的客户维护费	72,009.67

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,720.33

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计

创金合信基金	0.00	3,840.56	3,840.56
第一创业证券	0.00	0.65	0.65
招商银行	0.00	2,626.34	2,626.34
合计	-	6,467.55	6,467.55

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信MSCI中国A股国际指数A

份额单位：份

项目	本期
	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	5,000,450.09
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09

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	5,000,450.09
报告期末持有的基金份 额占基金总份额比例	6.44%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

份额单位：份

项目	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018 年02月07日）持有的基 金份额	5,000,450.00
报告期初持有的基金份 额	5,000,450.00
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	5,000,450.00
报告期末持有的基金份 额占基金总份额比例	27.42%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行 股份有限公司	1,306,591.56	28,264.82

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	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
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	70,600	552,122.00	527,382.00	-
601727	上海电气	2018-06-	重大事项	6.34	2018-08-	5.71	31,100	192,879.00	197,174.00	-

		06	停牌		07					
0023 10	东方 园林	2018 -05- 25	重大 事项 停牌	15.0 3	-	-	10,600	195,731.00	159,318.00	-
0026 02	世纪 华通	2018 -06- 12	重大 事项 停牌	32.5 0	-	-	4,800	159,463.00	156,000.00	-
0008 25	太钢 不锈	2018 -04- 16	重大 事项 停牌	6.00	-	-	20,900	135,078.00	125,400.00	-
6011 18	海南 橡胶	2018 -05- 24	重大 事项 停牌	6.62	-	-	16,500	90,255.00	109,230.00	-
0024 08	齐翔 腾达	2018 -06- 19	重大 事项 停牌	12.2 8	-	-	7,000	95,941.00	85,960.00	-
0023 59	北讯 集团	2018 -05- 21	重大 事项 停牌	19.5 8	2018 -08- 21	17.6 2	4,100	109,498.00	80,278.00	-
6000 22	山东 钢铁	2018 -03- 27	重大 事项 停牌	2.02	2018 -08- 16	1.83	38,600	84,434.00	77,972.00	-
0022 10	飞马 国际	2018 -03- 26	重大 事项 停牌	12.3 3	2018 -08- 13	11.0 7	5,800	74,875.00	71,514.00	-
0020 51	中工 国际	2018 -04- 09	重大 事项 停牌	15.2 7	-	-	3,900	64,127.00	59,553.00	-
0000 08	神州 高铁	2018 -06- 06	重大 事项 停牌	4.96	2018 -08- 07	4.46	11,100	82,500.00	55,056.00	-
6006 87	刚泰 控股	2018 -06- 11	重大 事项 停牌	9.09	2018 -08- 20	8.18	5,900	64,315.00	53,631.00	-
0025 73	清新 环境	2018 -06- 19	重大 事项 停牌	11.5 5	-	-	4,200	61,974.00	48,510.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为期限一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

6.4.13.2.2 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 2018年06月30日
AAA	0.00
AAA以下	0.00
未评级	4,015,200.00
合计	4,015,200.00

未评级债券为期限一年以上的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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可流通股不得超过该上市公司可流通股票的15%。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%。本基金所持大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，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。于2018年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为84,645,859.27元，超过经确认的当日净赎回金额。于2018年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为2.08%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。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。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,306,591.56	-	-	-	1,306,591.56
结算备	192,970.74	-	-	-	192,970.74

付金					
存出保证金	177,838.95	-	-	-	177,838.95
交易性金融资产	4,015,200.00	-	-	81,095,420.50	85,110,620.50
应收利息	-	-	-	35,954.82	35,954.82
应收申购款	-	-	-	65,016.43	65,016.43
资产总计	5,692,601.25	-	-	81,196,391.75	86,888,993.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	60,835.47	60,835.47
应付管理人报酬	-	-	-	37,306.98	37,306.98
应付托管费	-	-	-	7,461.40	7,461.40
应付销售服务费	-	-	-	2,814.53	2,814.53
应付交易费用	-	-	-	8,545.50	8,545.50
其他负债	-	-	-	96,166.98	96,166.98
负债总计	-	-	-	213,130.86	213,130.86
利率敏感度缺口	5,692,601.25	-	-	80,983,260.89	86,675,862.14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为4.63%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	81,095,420.50	93.56
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
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	81,095,420.50	93.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2018年06月30日
	比较基准上涨5%资产净值变动	4,184,566.08
	比较基准下降5%资产净值变动	-4,184,566.08

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为79,288,442.50元，第二层次的余额为5,822,178.00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。

(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2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,095,420.50	93.33
	其中：股票	81,095,420.50	93.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,015,200.00	4.62
	其中：债券	4,015,200.00	4.62
	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	1,499,562.30	1.73
8	其他各项资产	278,810.20	0.32
9	合计	86,888,993.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	371,920.00	0.43
B	采矿业	2,898,174.40	3.34
C	制造业	37,354,206.60	43.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,378,123.00	2.74
E	建筑业	2,568,512.00	2.96
F	批发和零售业	2,450,949.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	2,577,964.00	2.97
H	住宿和餐饮业	180,862.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,370,898.50	2.74
J	金融业	19,966,022.80	23.04
K	房地产业	4,424,921.00	5.11
L	租赁和商务服务业	1,198,370.20	1.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	189,139.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	276,624.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	380,483.00	0.44

S	综合	170,930.00	0.20
	合计	79,758,099.50	92.02

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	109,230.00	0.13
B	采矿业	-	-
C	制造业	409,962.00	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	746,253.00	0.86
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	362.00	0.00
L	租赁和商务服务业	71,514.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,337,321.00	1.54

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,900	3,584,154.00	4.14
2	601318	中国平安	42,700	2,501,366.00	2.89
3	000333	美的集团	25,900	1,352,498.00	1.56
4	002415	海康威视	36,400	1,351,532.00	1.56
5	601166	兴业银行	82,000	1,180,800.00	1.36
6	601398	工商银行	213,000	1,133,160.00	1.31
7	000858	五粮液	14,900	1,132,400.00	1.31
8	600000	浦发银行	115,900	1,108,004.00	1.28
9	600276	恒瑞医药	14,500	1,098,520.00	1.27
10	600104	上汽集团	30,700	1,074,193.00	1.24
11	000002	万科A	38,400	944,640.00	1.09
12	600900	长江电力	57,900	934,506.00	1.08
13	601668	中国建筑	165,900	905,814.00	1.05
14	601328	交通银行	155,000	889,700.00	1.03
15	600016	民生银行	116,700	816,900.00	0.94
16	601288	农业银行	232,300	799,112.00	0.92
17	601601	中国太保	24,800	789,880.00	0.91
18	002304	洋河股份	5,900	776,440.00	0.90
19	601988	中国银行	194,200	701,062.00	0.81
20	600887	伊利股份	24,000	669,600.00	0.77
21	600028	中国石化	100,600	652,894.00	0.75
22	603288	海天味业	8,800	648,032.00	0.75
23	600030	中信证券	38,800	642,916.00	0.74
24	601766	中国中车	80,100	616,770.00	0.71
25	000001	平安银行	67,800	616,302.00	0.71
26	601818	光大银行	157,200	575,352.00	0.66

27	600019	宝钢股份	73,300	571,007.00	0.66
28	600048	保利地产	46,800	570,960.00	0.66
29	000651	格力电器	11,800	556,370.00	0.64
30	600585	海螺水泥	15,800	528,984.00	0.61
31	002024	苏宁易购	36,800	518,144.00	0.60
32	601169	北京银行	83,500	503,505.00	0.58
33	601888	中国国旅	7,700	495,957.00	0.57
34	001979	招商蛇口	26,000	495,300.00	0.57
35	601857	中国石油	63,900	492,669.00	0.57
36	601229	上海银行	30,800	485,408.00	0.56
37	601006	大秦铁路	58,700	481,927.00	0.56
38	000725	京东方 A	133,800	473,652.00	0.55
39	002027	分众传媒	48,360	462,805.20	0.53
40	600690	青岛海尔	24,000	462,240.00	0.53
41	600518	康美药业	19,600	448,448.00	0.52
42	000538	云南白药	4,100	438,536.00	0.51
43	601211	国泰君安	29,700	437,778.00	0.51
44	601186	中国铁建	45,500	392,210.00	0.45
45	600015	华夏银行	50,700	377,715.00	0.44
46	601336	新华保险	8,200	351,616.00	0.41
47	000568	泸州老窖	5,700	346,902.00	0.40
48	002594	比亚迪	7,100	338,528.00	0.39
49	600196	复星医药	7,900	326,981.00	0.38
50	002142	宁波银行	20,000	325,800.00	0.38
51	000166	申万宏源	74,200	324,254.00	0.37
52	601688	华泰证券	21,500	321,855.00	0.37
53	000776	广发证券	23,400	310,518.00	0.36
54	600703	三安光电	16,100	309,442.00	0.36
55	600999	招商证券	22,600	309,168.00	0.36
56	600837	海通证券	31,900	302,093.00	0.35
57	600340	华夏幸福	11,600	298,700.00	0.34

58	600741	华域汽车	12,400	294,128.00	0.34
59	600919	江苏银行	45,600	292,296.00	0.34
60	601985	中国核电	51,300	289,845.00	0.33
61	601933	永辉超市	37,800	288,792.00	0.33
62	000895	双汇发展	10,800	285,228.00	0.33
63	002475	立讯精密	12,500	281,750.00	0.33
64	002044	美年健康	12,240	276,624.00	0.32
65	601155	新城控股	8,900	275,633.00	0.32
66	000963	华东医药	5,700	275,025.00	0.32
67	600031	三一重工	30,400	272,688.00	0.31
68	002230	科大讯飞	8,250	264,577.50	0.31
69	601009	南京银行	33,500	258,955.00	0.30
70	600436	片仔癀	2,300	257,439.00	0.30
71	002236	大华股份	11,400	257,070.00	0.30
72	601939	建设银行	37,900	248,245.00	0.29
73	601899	紫金矿业	68,400	246,924.00	0.28
74	601628	中国人寿	10,900	245,468.00	0.28
75	601618	中国中冶	70,600	235,098.00	0.27
76	600029	南方航空	27,800	234,910.00	0.27
77	000069	华侨城 A	32,400	234,252.00	0.27
78	600010	包钢股份	150,400	233,120.00	0.27
79	603799	华友钴业	2,300	224,181.00	0.26
80	002008	大族激光	4,200	223,398.00	0.26
81	002466	天齐锂业	4,500	223,155.00	0.26
82	601901	方正证券	32,500	217,425.00	0.25
83	601225	陕西煤业	26,400	217,008.00	0.25
84	601669	中国电建	40,300	216,008.00	0.25
85	600958	东方证券	23,600	215,468.00	0.25
86	600115	东方航空	32,400	214,488.00	0.25
87	600809	山西汾酒	3,400	213,826.00	0.25
88	600009	上海机场	3,800	210,824.00	0.24

89	000338	潍柴动力	24,000	210,000.00	0.24
90	600606	绿地控股	32,100	209,934.00	0.24
91	600332	白云山	5,500	209,275.00	0.24
92	600660	福耀玻璃	7,900	203,109.00	0.23
93	600893	航发动力	8,900	198,648.00	0.23
94	601727	上海电气	31,100	197,174.00	0.23
95	600867	通化东宝	8,140	195,115.80	0.23
96	600886	国投电力	26,800	194,836.00	0.22
97	600085	同仁堂	5,400	190,512.00	0.22
98	601877	正泰电器	8,500	189,720.00	0.22
99	601012	隆基股份	11,060	184,591.40	0.21
100	600271	航天信息	7,300	184,471.00	0.21
101	002422	科伦药业	5,700	182,970.00	0.21
102	600588	用友网络	7,450	182,599.50	0.21
103	601607	上海医药	7,600	181,640.00	0.21
104	600383	金地集团	17,800	181,382.00	0.21
105	603993	洛阳钼业	28,000	176,120.00	0.20
106	600547	山东黄金	7,300	174,616.00	0.20
107	002456	欧菲科技	10,700	172,591.00	0.20
108	600516	方大炭素	7,000	170,660.00	0.20
109	000768	中航飞机	10,900	170,476.00	0.20
110	601788	光大证券	15,500	170,190.00	0.20
111	002714	牧原股份	3,800	168,948.00	0.19
112	002460	赣锋锂业	4,350	167,823.00	0.19
113	600023	浙能电力	35,900	167,294.00	0.19
114	600066	宇通客车	8,700	166,953.00	0.19
115	600705	中航资本	35,600	166,252.00	0.19
116	600760	中航沈飞	4,600	165,784.00	0.19
117	600018	上港集团	27,500	163,900.00	0.19
118	600111	北方稀土	14,400	163,872.00	0.19
119	600487	亨通光电	7,420	163,611.00	0.19

120	002001	新和成	8,530	161,728.80	0.19
121	600926	杭州银行	14,500	160,805.00	0.19
122	002050	三花智控	8,400	158,340.00	0.18
123	600637	东方明珠	10,400	156,624.00	0.18
124	600816	安信信托	21,620	156,528.80	0.18
125	002602	世纪华通	4,800	156,000.00	0.18
126	600352	浙江龙盛	12,900	154,155.00	0.18
127	600535	天士力	5,880	151,821.60	0.18
128	600674	川投能源	17,400	151,728.00	0.18
129	002146	荣盛发展	17,200	150,156.00	0.17
130	601919	中远海控	30,200	148,584.00	0.17
131	002736	国信证券	16,200	147,420.00	0.17
132	002202	金风科技	11,500	145,360.00	0.17
133	600176	中国巨石	13,820	141,378.60	0.16
134	603589	口子窖	2,300	141,335.00	0.16
135	601111	中国国航	15,800	140,462.00	0.16
136	601998	中信银行	22,500	139,725.00	0.16
137	601377	兴业证券	26,500	139,655.00	0.16
138	000625	长安汽车	15,400	138,600.00	0.16
139	000661	长春高新	600	136,620.00	0.16
140	000423	东阿阿胶	2,500	134,525.00	0.16
141	000596	古井贡酒	1,500	133,170.00	0.15
142	000413	东旭光电	21,700	131,502.00	0.15
143	600521	华海药业	4,920	131,314.80	0.15
144	601117	中国化学	19,500	131,235.00	0.15
145	600068	葛洲坝	18,200	131,222.00	0.15
146	002311	海大集团	6,200	130,820.00	0.15
147	002241	歌尔股份	12,800	130,432.00	0.15
148	600362	江西铜业	8,200	129,970.00	0.15
149	600208	新湖中宝	34,000	129,880.00	0.15
150	000786	北新建材	7,000	129,710.00	0.15

151	600570	恒生电子	2,400	127,080.00	0.15
152	600027	华电国际	32,300	126,616.00	0.15
153	002294	信立泰	3,400	126,378.00	0.15
154	002558	巨人网络	5,300	126,034.00	0.15
155	600297	广汇汽车	21,500	125,990.00	0.15
156	600998	九州通	7,400	125,504.00	0.14
157	600566	济川药业	2,600	125,294.00	0.14
158	000709	河钢股份	42,100	124,195.00	0.14
159	601233	桐昆股份	7,200	123,984.00	0.14
160	600011	华能国际	19,400	123,384.00	0.14
161	601800	中国交建	10,800	123,012.00	0.14
162	002410	广联达	4,400	122,012.00	0.14
163	000977	浪潮信息	5,100	121,635.00	0.14
164	002179	中航光电	3,100	120,900.00	0.14
165	000792	盐湖股份	11,000	119,020.00	0.14
166	000938	紫光股份	1,900	118,940.00	0.14
167	000783	长江证券	21,900	118,917.00	0.14
168	600977	中国电影	7,400	118,696.00	0.14
169	601198	东兴证券	9,100	118,664.00	0.14
170	600482	中国动力	6,800	118,660.00	0.14
171	600600	青岛啤酒	2,700	118,341.00	0.14
172	000418	小天鹅 A	1,700	117,895.00	0.14
173	000425	徐工机械	27,700	117,448.00	0.14
174	002493	荣盛石化	11,300	116,616.00	0.13
175	002572	索菲亚	3,600	115,848.00	0.13
176	002007	华兰生物	3,600	115,776.00	0.13
177	603858	步长制药	2,700	115,533.00	0.13
178	000050	深天马 A	8,100	115,182.00	0.13
179	603019	中科曙光	2,500	114,675.00	0.13
180	000627	天茂集团	16,300	114,426.00	0.13
181	600298	安琪酵母	3,200	114,176.00	0.13

182	600398	海澜之家	8,900	113,386.00	0.13
183	002508	老板电器	3,700	113,294.00	0.13
184	600426	华鲁恒升	6,400	112,576.00	0.13
185	601997	贵阳银行	9,100	112,476.00	0.13
186	603369	今世缘	4,900	111,867.00	0.13
187	600688	上海石化	19,400	110,386.00	0.13
188	600497	驰宏锌锗	20,200	110,090.00	0.13
189	600256	广汇能源	26,860	109,857.40	0.13
190	600498	烽火通信	4,400	109,340.00	0.13
191	600177	雅戈尔	14,200	109,340.00	0.13
192	601699	潞安环能	11,800	109,268.00	0.13
193	601992	金隅集团	33,100	108,568.00	0.13
194	002032	苏泊尔	2,100	108,150.00	0.12
195	002013	中航机电	14,250	107,872.50	0.12
196	600004	白云机场	8,200	107,338.00	0.12
197	600170	上海建工	35,300	107,312.00	0.12
198	002065	东华软件	12,400	106,640.00	0.12
199	600522	中天科技	12,100	106,601.00	0.12
200	002081	金螳螂	10,500	106,050.00	0.12
201	002049	紫光国微	2,400	105,888.00	0.12
202	000876	新希望	16,700	105,878.00	0.12
203	000999	华润三九	3,800	105,754.00	0.12
204	600779	水井坊	1,900	104,937.00	0.12
205	000157	中联重科	25,400	104,394.00	0.12
206	600438	通威股份	15,100	104,190.00	0.12
207	002673	西部证券	13,800	104,190.00	0.12
208	002601	龙鳞佰利	8,000	103,440.00	0.12
209	600258	首旅酒店	3,800	103,246.00	0.12
210	600315	上海家化	2,600	103,038.00	0.12
211	601018	宁波港	24,400	102,724.00	0.12
212	002038	双鹭药业	2,700	102,573.00	0.12

213	002217	合力泰	12,400	102,300.00	0.12
214	600089	特变电工	14,700	101,871.00	0.12
215	002153	石基信息	3,500	101,500.00	0.12
216	000656	金科股份	21,100	101,280.00	0.12
217	002405	四维图新	5,000	101,250.00	0.12
218	600153	建发股份	11,200	100,688.00	0.12
219	002078	太阳纸业	10,300	99,807.00	0.12
220	600219	南山铝业	36,600	99,186.00	0.11
221	000830	鲁西化工	5,800	99,064.00	0.11
222	000728	国元证券	13,300	98,420.00	0.11
223	002271	东方雨虹	5,780	98,317.80	0.11
224	000826	启迪桑德	5,600	97,888.00	0.11
225	600884	杉杉股份	4,400	97,240.00	0.11
226	000671	阳光城	16,000	95,520.00	0.11
227	000732	泰禾集团	4,900	95,305.00	0.11
228	601333	广深铁路	22,400	95,200.00	0.11
229	603899	晨光文具	3,000	95,070.00	0.11
230	600699	均胜电子	3,700	95,053.00	0.11
231	000402	金融街	11,800	94,990.00	0.11
232	000983	西山煤电	12,500	93,875.00	0.11
233	002506	协鑫集成	20,000	93,600.00	0.11
234	601238	广汽集团	8,400	93,576.00	0.11
235	002624	完美世界	3,000	93,030.00	0.11
236	000961	中南建设	14,700	92,757.00	0.11
237	600489	中金黄金	13,600	92,752.00	0.11
238	600415	小商品城	21,500	92,665.00	0.11
239	000998	隆平高科	4,900	92,414.00	0.11
240	000630	铜陵有色	41,800	92,378.00	0.11
241	600583	海油工程	17,500	92,050.00	0.11
242	002372	伟星新材	5,200	91,988.00	0.11
243	600038	中直股份	2,300	91,977.00	0.11

244	603883	老百姓	1,100	91,476.00	0.11
245	600584	长电科技	5,400	91,476.00	0.11
246	002340	格林美	15,100	91,355.00	0.11
247	002127	南极电商	9,700	91,083.00	0.11
248	600739	辽宁成大	6,000	91,080.00	0.11
249	603885	吉祥航空	5,900	90,919.00	0.10
250	002399	海普瑞	4,100	90,774.00	0.10
251	600642	申能股份	18,000	90,360.00	0.10
252	000898	鞍钢股份	16,200	90,234.00	0.10
253	601098	中南传媒	7,100	89,744.00	0.10
254	002371	北方华创	1,800	89,406.00	0.10
255	600704	物产中大	17,000	88,910.00	0.10
256	002640	跨境通	5,900	88,618.00	0.10
257	600885	宏发股份	2,940	87,964.80	0.10
258	600118	中国卫星	4,600	87,860.00	0.10
259	600872	中炬高新	3,100	86,800.00	0.10
260	600369	西南证券	22,400	86,240.00	0.10
261	600392	盛和资源	5,300	86,019.00	0.10
262	002408	齐翔腾达	7,000	85,960.00	0.10
263	600967	内蒙一机	6,700	85,358.00	0.10
264	600109	国金证券	12,000	85,320.00	0.10
265	600808	马钢股份	23,700	85,083.00	0.10
266	600549	厦门钨业	5,590	84,856.20	0.10
267	601021	春秋航空	2,400	84,072.00	0.10
268	600062	华润双鹤	3,400	83,470.00	0.10
269	000066	中国长城	11,700	83,187.00	0.10
270	002019	亿帆医药	4,700	82,955.00	0.10
271	000623	吉林敖东	4,600	82,708.00	0.10
272	002092	中泰化学	8,500	81,940.00	0.09
273	600909	华安证券	14,300	81,796.00	0.09
274	601555	东吴证券	11,900	81,277.00	0.09

275	600511	国药股份	3,000	80,850.00	0.09
276	002085	万丰奥威	8,600	80,840.00	0.09
277	002589	瑞康医药	5,900	80,476.00	0.09
278	002359	北讯集团	4,100	80,278.00	0.09
279	000513	丽珠集团	1,820	79,989.00	0.09
280	000960	锡业股份	6,600	79,266.00	0.09
281	000975	银泰资源	7,800	79,092.00	0.09
282	600160	巨化股份	10,790	78,982.80	0.09
283	601866	中远海发	31,500	78,435.00	0.09
284	600201	生物股份	4,550	77,759.50	0.09
285	600754	锦江股份	2,100	77,616.00	0.09
286	600282	南钢股份	17,500	77,350.00	0.09
287	002180	纳思达	2,800	76,888.00	0.09
288	600056	中国医药	4,200	76,734.00	0.09
289	600183	生益科技	8,300	76,028.00	0.09
290	002223	鱼跃医疗	3,900	76,011.00	0.09
291	600879	航天电子	10,800	75,924.00	0.09
292	600372	中航电子	5,800	75,748.00	0.09
293	002500	山西证券	11,200	75,488.00	0.09
294	600260	凯乐科技	2,800	75,152.00	0.09
295	002195	二三四五	17,550	75,114.00	0.09
296	000729	燕京啤酒	11,100	74,703.00	0.09
297	002439	启明星辰	3,500	74,270.00	0.09
298	000559	万向钱潮	10,900	74,120.00	0.09
299	600380	健康元	6,200	73,532.00	0.08
300	000839	中信国安	15,500	73,315.00	0.08
301	600820	隧道股份	12,400	73,284.00	0.08
302	002465	海格通信	9,100	73,073.00	0.08
303	000581	威孚高科	3,300	72,963.00	0.08
304	002745	木林森	4,100	72,939.00	0.08
305	600466	蓝光发展	11,760	72,912.00	0.08

306	600061	国投资本	7,800	72,384.00	0.08
307	002268	卫 士 通	3,300	72,039.00	0.08
308	600376	首开股份	10,200	71,706.00	0.08
309	000883	湖北能源	17,200	70,692.00	0.08
310	000887	中鼎股份	4,900	70,609.00	0.08
311	600409	三友化工	8,200	70,602.00	0.08
312	600782	新钢股份	12,600	70,308.00	0.08
313	600895	张江高科	6,100	70,150.00	0.08
314	600079	人福医药	5,300	70,066.00	0.08
315	000028	国药一致	1,400	69,860.00	0.08
316	600567	山鹰纸业	18,000	69,480.00	0.08
317	601179	中国西电	20,300	69,426.00	0.08
318	600373	中文传媒	5,400	69,390.00	0.08
319	002385	大北农	16,800	69,384.00	0.08
320	002926	华西证券	6,900	69,276.00	0.08
321	000060	中金岭南	14,150	68,769.00	0.08
322	600060	海信电器	5,100	68,289.00	0.08
323	002555	三七互娱	5,600	68,040.00	0.08
324	600348	阳泉煤业	9,500	67,925.00	0.08
325	002174	游族网络	3,400	67,660.00	0.08
326	600648	外高桥	3,700	67,636.00	0.08
327	000778	新兴铸管	15,800	67,624.00	0.08
328	600787	中储股份	8,700	67,338.00	0.08
329	600804	鹏博士	5,600	67,200.00	0.08
330	601958	金钼股份	10,600	66,462.00	0.08
331	002925	盈趣科技	1,200	66,456.00	0.08
332	000039	中集集团	5,000	66,400.00	0.08
333	002603	以岭药业	4,700	65,706.00	0.08
334	600161	天坛生物	3,380	65,403.00	0.08
335	000027	深圳能源	13,100	64,714.00	0.07
336	600827	百联股份	6,300	64,260.00	0.07

337	600598	北大荒	7,000	64,120.00	0.07
338	600021	上海电力	9,500	64,030.00	0.07
339	600718	东软集团	4,900	63,994.00	0.07
340	002244	滨江集团	12,300	63,960.00	0.07
341	002424	贵州百灵	5,600	63,616.00	0.07
342	002221	东华能源	6,500	63,505.00	0.07
343	600460	士兰微	5,200	63,440.00	0.07
344	002074	国轩高科	4,500	63,270.00	0.07
345	601099	太平洋	27,000	63,180.00	0.07
346	000997	新大陆	4,000	63,000.00	0.07
347	002353	杰瑞股份	3,800	61,750.00	0.07
348	601966	玲珑轮胎	3,900	61,503.00	0.07
349	002517	恺英网络	8,550	61,474.50	0.07
350	600649	城投控股	10,000	61,200.00	0.07
351	600737	中粮糖业	8,100	61,074.00	0.07
352	603077	和邦生物	35,000	60,550.00	0.07
353	600835	上海机电	3,200	60,352.00	0.07
354	600582	天地科技	16,400	60,188.00	0.07
355	600643	爱建集团	6,400	60,160.00	0.07
356	601801	皖新传媒	7,900	60,119.00	0.07
357	000738	航发控制	4,500	59,985.00	0.07
358	000750	国海证券	16,700	59,619.00	0.07
359	000686	东北证券	9,300	59,613.00	0.07
360	601880	大连港	30,700	59,558.00	0.07
361	600777	新潮能源	27,000	59,130.00	0.07
362	601168	西部矿业	9,400	59,032.00	0.07
363	000537	广宇发展	6,100	58,804.00	0.07
364	601718	际华集团	14,500	58,290.00	0.07
365	600266	北京城建	6,200	58,280.00	0.07
366	002583	海能达	6,900	57,615.00	0.07
367	000937	冀中能源	14,000	57,540.00	0.07

368	600291	西水股份	4,300	57,448.00	0.07
369	600575	皖江物流	15,400	57,134.00	0.07
370	600037	歌华有线	5,500	56,760.00	0.07
371	002152	广电运通	9,600	56,448.00	0.07
372	002176	江特电机	5,800	56,376.00	0.07
373	600500	中化国际	8,200	55,924.00	0.06
374	002183	怡亚通	8,400	55,860.00	0.06
375	600143	金发科技	10,700	55,854.00	0.06
376	002491	通鼎互联	5,000	55,350.00	0.06
377	601000	唐山港	23,520	55,272.00	0.06
378	000008	神州高铁	11,100	55,056.00	0.06
379	600525	长园集团	5,200	54,964.00	0.06
380	601611	中国核建	6,900	54,510.00	0.06
381	600166	福田汽车	26,500	53,795.00	0.06
382	600687	刚泰控股	5,900	53,631.00	0.06
383	000807	云铝股份	10,300	53,354.00	0.06
384	600839	四川长虹	18,300	52,338.00	0.06
385	600863	内蒙华电	23,000	52,210.00	0.06
386	002285	世联行	8,100	50,787.00	0.06
387	002701	奥瑞金	9,300	50,778.00	0.06
388	000088	盐田港	7,700	50,743.00	0.06
389	600717	天津港	6,600	49,698.00	0.06
390	601375	中原证券	10,600	49,502.00	0.06
391	002280	联络互动	8,600	49,192.00	0.06
392	600418	江淮汽车	7,500	48,825.00	0.06
393	002573	清新环境	4,200	48,510.00	0.06
394	601258	庞大集团	26,500	48,495.00	0.06
395	600435	北方导航	5,900	48,144.00	0.06
396	000598	兴蓉环境	11,800	47,908.00	0.06
397	000800	一汽轿车	6,400	47,872.00	0.06
398	600597	光明乳业	4,800	47,376.00	0.05

399	000401	冀东水泥	5,300	47,011.00	0.05
400	002131	利欧股份	22,200	46,620.00	0.05
401	002505	大康农业	21,700	46,438.00	0.05
402	600026	中远海能	10,800	45,792.00	0.05
403	002292	奥飞娱乐	5,100	45,543.00	0.05
404	600252	中恒集团	13,800	44,712.00	0.05
405	601200	上海环境	2,700	42,741.00	0.05
406	000519	中兵红箭	5,500	42,735.00	0.05
407	600873	梅花生物	10,200	42,636.00	0.05
408	600633	浙数文化	5,100	42,534.00	0.05
409	000009	中国宝安	8,500	41,650.00	0.05
410	002249	大洋电机	9,400	40,514.00	0.05
411	600317	营口港	17,100	38,646.00	0.04
412	600446	金证股份	3,300	36,333.00	0.04
413	000712	锦龙股份	3,500	34,930.00	0.04
414	002354	天神娱乐	3,700	34,262.00	0.04

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

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	601390	中国中铁	70,600	527,382.00	0.61
2	000063	中兴通讯	12,600	164,178.00	0.19
3	002310	东方园林	10,600	159,318.00	0.18
4	000825	太钢不锈	20,900	125,400.00	0.14
5	601118	海南橡胶	16,500	109,230.00	0.13
6	600022	山东钢铁	38,600	77,972.00	0.09
7	002210	飞马国际	5,800	71,514.00	0.08
8	002051	中工国际	3,900	59,553.00	0.07
9	002002	鸿达兴业	9,200	42,412.00	0.05
10	600393	粤泰股份	100	362.00	-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,705,235.88	4.27
2	601318	中国平安	3,008,079.00	3.47
3	600000	浦发银行	1,502,438.00	1.73
4	002415	海康威视	1,495,948.40	1.73
5	601166	兴业银行	1,493,605.00	1.72
6	601398	工商银行	1,451,130.00	1.67
7	000333	美的集团	1,444,751.00	1.67
8	000002	万科A	1,288,097.00	1.49
9	000858	五粮液	1,129,329.00	1.30
10	601668	中国建筑	1,100,655.00	1.27
11	600104	上汽集团	1,058,069.50	1.22
12	601328	交通银行	1,041,866.00	1.20
13	601766	中国中车	1,024,746.00	1.18
14	600016	民生银行	1,015,351.00	1.17
15	601601	中国太保	1,001,827.00	1.16
16	600900	长江电力	998,067.00	1.15
17	601288	农业银行	989,965.00	1.14
18	600276	恒瑞医药	852,778.00	0.98
19	601988	中国银行	840,830.00	0.97
20	000001	平安银行	833,410.00	0.96

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600519	贵州茅台	215,148.00	0.25
2	601766	中国中车	157,755.00	0.18
3	002411	必康股份	136,387.00	0.16
4	600663	陆家嘴	103,149.00	0.12
5	002493	荣盛石化	82,841.00	0.10
6	601318	中国平安	81,049.00	0.09
7	601991	大唐发电	65,331.00	0.08
8	600900	长江电力	58,059.00	0.07
9	601928	凤凰传媒	53,946.00	0.06
10	002299	圣农发展	53,814.00	0.06
11	000959	首钢股份	52,110.00	0.06
12	601018	宁波港	48,625.00	0.06
13	002444	巨星科技	48,412.00	0.06
14	002030	达安基因	46,676.00	0.05
15	600978	宜华生活	46,088.00	0.05
16	603000	人民网	45,622.00	0.05
17	000718	苏宁环球	44,275.00	0.05
18	600639	浦东金桥	44,150.00	0.05
19	000563	陕国投 A	43,896.00	0.05
20	000002	万科 A	43,610.00	0.05

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	93,797,820.34
卖出股票收入(成交)总额	2,820,002.00

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,015,200.00	4.63
	其中：政策性金融债	4,015,200.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,015,200.00	4.63

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	40,000	4,015,200.00	4.63

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1809	IF1809	1	1,032,840.	-78,480.00	-

			00		
公允价值变动总额合计（元）					-78,480.00
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-78,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内持有少量股指期货合约，主要是为了进行多头套保，应对大额申赎和便利流动性管理。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2018年1月19日，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局（以下简称“银监会四川监管局”）行政处罚决定书（川银监罚字【2018】2号），决定对公司成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款46,175万元人民币。此外，对成都分行原行长、2名副行长、1名部门负责人和1名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。

本基金投研认为，对此处罚决定，该公司坚决支持和接受，并深表歉意。针对上述违规行为，该公司高度重视，并严格履行信披义务，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。该公司还公告表示，上述处罚金额已全额计入2017年度公司损益，对公司的后续业务开展及持续经营无重大不利影响。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该公司进行了投资。

2018年4月19日，兴业银行股份有限公司（下称“兴业银行”，股票代码：601166）受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚（银保监银罚决字（2018）1号），该处罚认定兴业银行存在以下主要违法事实：

- （一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；
- （二）非真实转让信贷资产；
- （三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；

(四) 内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；

(五) 同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；

(六) 债券卖出回购业务违规出表；

(七) 个人理财资金违规投资；

(八) 提供日期倒签的材料；

(九) 部分非现场监管统计数据与事实不符；

(十) 个别董事未经任职资格核准即履职；

(十一) 变相批量转让个人贷款；

(十二) 向四证不全的房地产项目提供融资。

违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》等相关法律法规，对公司处以罚款 5870 万元。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，兴业银行迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后公司经营状况正常，另外 5870 万元罚款对业绩影响有限。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兴业银行进行了投资。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	177,838.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,954.82
5	应收申购款	65,016.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	278,810.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601390	中国中铁	527,382.00	0.61	重大事项停牌
2	002310	东方园林	159,318.00	0.18	重大事项停牌
3	000825	太钢不锈	125,400.00	0.14	重大事项停牌
4	601118	海南橡胶	109,230.00	0.13	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信MSCI中国A股国际指数A	1,645	47,170.72	9,858,092.69	12.70%	67,737,747.11	87.30%

创金合信MSCI中国A股国际指数C	878	20,769.03	5,000,450.00	27.42%	13,234,756.64	72.58%
合计	2,464	38,892.47	14,858,542.69	15.50%	80,972,503.75	84.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	194,974.97	0.25%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	120,069.30	0.66%
	合计	315,044.27	0.33%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	10.44%	10,000,900.09	10.44%	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	10,000,900.09	10.44%	10,000,900.09	10.44%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	55,960,583.31	12,417,879.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	27,947,204.92	9,086,725.78
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,311,948.43	3,269,398.81
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	77, 595, 839. 80	18, 235, 206. 64
-------------	------------------	------------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一	2	88, 882, 277. 34	92. 01%	64, 399. 83	95. 16%	-

创业 证券						
招商 证券	2	7,722,387.00	7.99%	3,274.98	4.84%	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-
安信 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-

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。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成	占当期权	成	占当期基

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	交金额	证成交总额的比例	交金额	金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	3,010,194.40	75.04%	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,001,000.00	24.96%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-06
2	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-06
3	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同内容摘要	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-06
4	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-06
5	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-06
6	创金合信基金关于创金合信MSCI中国A股国际指数发起	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-09

	式证券投资基金增加部分代销机构的公告		
7	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代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-10
8	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代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-15
9	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华泰证券为代销机构暨参加华泰证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-17
10	创金合信基金管理有限公司关于创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金增加中投证券为代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-24
11	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苏宁金融为代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-01-29
12	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-02-08
13	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-03-02
14	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、中国证券报、上海证券报	2018-03-02
15	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-03-16

	加代销机构的公告		
16	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第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-04-02
17	创金合信基金管理有限公司关于创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金增加部分代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-04-11
18	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与银河证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-05-18
19	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、中国证券报、上海证券报	2018-06-16
20	创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-06-21
21	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济安财富为代销机构的公告	公司官网、中国证券报、上海证券报	2018-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2018年半年度报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日