
创金合信国证 A 股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01月01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	12
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	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信国证A股指数	
基金主代码	005414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月28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	11,688,702.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信国证A股指 数A	创金合信国证A股指 数C
下属分级基金的交易代码	005414	005415
报告期末下属分级基金的份额总额	5,679,811.34份	6,008,891.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内。
业绩比较基准	国证A股指数收益率×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、证券时报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	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01月01日-2018年06月30日)
---------------	------------------------------

	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
本期已实现收益	-73,862.58	-82,741.58
本期利润	-762,721.68	-780,589.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1324	-0.1335
本期加权平均净值利润率	-13.69%	-13.81%
本期基金份额净值增长率	-13.38%	-13.49%
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	-750,105.28	-800,276.66
期末可供分配基金份额利润	-0.1321	-0.1332
期末基金资产净值	4,929,706.06	5,208,614.69
期末基金份额净值	0.8679	0.8668
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	-13.21%	-13.32%

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2017年12月28日，无上年度可比期间。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信国证A股指数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	-7.71%	1.46%	-7.94%	1.45%	0.23%	0.01%
过去三个月	-10.58%	1.16%	-11.14%	1.15%	0.56%	0.01%
过去六个月	-13.38%	1.18%	-13.86%	1.16%	0.48%	0.02%
自基金合同生效起至今	-13.21%	1.16%	-13.02%	1.14%	-0.19%	0.02%

创金合信国证A股指数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	-7.72%	1.46%	-7.94%	1.45%	0.22%	0.01%
过去三个月	-10.61%	1.16%	-11.14%	1.15%	0.53%	0.01%
过去六个月	-13.49%	1.18%	-13.86%	1.16%	0.37%	0.02%
自基金合同生效起至今	-13.32%	1.16%	-13.02%	1.14%	-0.30%	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



§ 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	2017-12-28	-	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国证A股指数，业绩基准为国证A股指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率（税后） \times 5%。国证A股指数的样本股为在深圳、上海证券交易所上市的除ST、*ST股票外的所有A股，于2005年2月3日发布，用以反映中国A股市场股票价格的整体表现。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股市场呈现连续下跌走势。本基金主要跟踪国证

A股指数走势，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国证A股指数A基金份额净值为0.8679元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.38%，同期业绩比较基准收益率为-13.86%；截至报告期末创金合信国证A股指数C基金份额净值为0.8668元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.49%，同期业绩比较基准收益率为-13.86%。

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：创金合信国证A股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	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	308,290.92	11,881,591.96
结算备付金		2,012.75	-
存出保证金		3,174.47	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,902,816.82	11,238,680.00
其中：股票投资		9,501,296.82	11,238,680.00
基金投资		-	-
债券投资		401,520.00	-
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	3,622.58	3,007.57
应收股利		-	-
应收申购款		22,173.11	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,242,090.65	23,123,279.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	11,206,470.17
应付赎回款		19,296.91	-
应付管理人报酬		4,287.84	489.02
应付托管费		857.55	97.80
应付销售服务费		872.13	97.74
应付交易费用	6.4.7.7	3,509.00	8,093.70
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	74,946.47	747.83
负债合计		103,769.90	11,215,996.26
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	11,688,702.69	11,883,173.75
未分配利润	6.4.7.1 0	-1,550,381.94	24,109.52

所有者权益合计		10,138,320.75	11,907,283.27
负债和所有者权益总计		10,242,090.65	23,123,279.53

注：1. 报告截止日2018年6月30日，基金份额总额11,688,702.69份，其中下属A类基金份额5,679,811.34份，C类基金份额6,008,891.35份。下属A类基金份额净值0.8679元，C类基金份额净值0.8668元。

2. 本基金合同生效日为2017年12月28日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		-1,401,524.96
1. 利息收入		5,403.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,223.23
债券利息收入		2,154.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,025.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-23,414.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-112,978.36
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	89,564.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,386,706.74
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	3,192.60

减：二、费用		141,785.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	27,786.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,557.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,596.39
4. 交易费用	6.4.7.18	18,003.85
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	84,841.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,543,310.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,543,310.90

注：本基金合同生效日为2017年12月28日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01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)	11,883,173.75	24,109.52	11,907,283.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,543,310.90	-1,543,310.90
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）	-194,471.06	-31,180.56	-225,651.62

其中：1. 基金申购款	1,003,302.58	-72,056.08	931,246.50
2. 基金赎回款	-1,197,773.64	40,875.52	-1,156,898.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,688,702.69	-1,550,381.94	10,138,320.75

注：本基金合同生效日为2017年12月28日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信国证A股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]第2125号《关于准予创金合信国证A股指数发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信国证A股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11,881,532.97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(2017)第1088号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》于2017年12月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为11,883,173.75份基金份额，其中认购资金利息折合1,640.78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《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,本基金可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:国证A股指数收益率 \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》、《创金合信国证A股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。

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卖出回购金融资产款和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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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[2008]38号《关于进一步规范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) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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	308,290.92
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	308,290.92

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	10,854,999.96	9,501,296.82	-1,353,703.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	401,320.00	401,520.00
	银行间市场	-	-
	合计	401,320.00	401,520.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,256,319.96	9,902,816.82	-1,353,503.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	57.76
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	0.90
应收债券利息	3,562.52

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	1.40
合计	3,622.58

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	3,509.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,509.00

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	-
预提费用	74,946.47
合计	74,946.47

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信国证A股指数A

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
----	---------------------------

(创金合信国证A股指数A)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,944,930.98	5,944,930.98
本期申购	326,926.86	326,926.86
本期赎回(以“-”号填列)	-592,046.50	-592,046.50
本期末	5,679,811.34	5,679,811.34

6.4.7.9.2 创金合信国证A股指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数C)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,938,242.77	5,938,242.77
本期申购	676,375.72	676,375.72
本期赎回(以“-”号填列)	-605,727.14	-605,727.14
本期末	6,008,891.35	6,008,891.35

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 创金合信国证A股指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,500.71	16,611.14	12,110.43
本期利润	-73,862.58	-688,859.10	-762,721.68
本期基金份额交易产生的变动数	1,041.63	-535.66	505.97
其中：基金申购款	-2,555.46	-13,496.45	-16,051.91
基金赎回款	3,597.09	12,960.79	16,557.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-77,321.66	-672,783.62	-750,105.28

6.4.7.10.2 创金合信国证A股指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指 数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,593.37	16,592.46	11,999.09
本期利润	-82,741.58	-697,847.64	-780,589.22
本期基金份额交易产 生的变动数	-1,950.01	-29,736.52	-31,686.53
其中：基金申购款	-8,545.65	-47,458.52	-56,004.17
基金赎回款	6,595.64	17,722.00	24,317.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-89,284.96	-710,991.70	-800,276.66

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	1,954.81
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	245.48
其他	22.94
合计	2,223.23

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	6,950,674.34
减：卖出股票成本总额	7,063,652.70
买卖股票差价收入	-112,978.36

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

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01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	89,564.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	89,564.25

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01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,386,706.74
——股票投资	-1,386,906.74
——债券投资	200.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,386,706.74

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	3,192.60
合计	3,192.60

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	18,003.85
银行间市场交易费用	-
合计	18,003.85

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	49,590.38
汇划手续费	395.00
账户维护费	1,500.00
指数使用费	16,000.00
合计	84,841.47

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
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01月01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	13,663,850.60	100.00%

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01月01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	401,320.00	100.00%

有限公司		
------	--	--

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	
	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	2,110,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30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	9,839.85	100.00%	3,509.00	100.00%

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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,786.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,536.33

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,557.35

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C	合计
创金合信 基金	0.00	4,783.57	4,783.57
合计	-	4,783.57	4,783.57

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

创金合信国证A股指数A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
	基金合同生效日（2017年12月28日）持有的基金份额

报告期初持有的基金份额	5,000,700.14
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	5,000,700.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	88.04%

创金合信国证A股指数C

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金合同生效日（2017年12月28日）持有的基金份额	5,000,700.00
报告期初持有的基金份额	5,000,700.00
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	5,000,700.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	83.22%

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01月01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	308,290.92	1,954.81

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

本基金于本期末未进行利润分配。

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
000616	海航投资	2018-01-	重大事项	3.42	2018-07-	3.08	7,300	24,455.00	24,966.00	-

		24	停牌		25					
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	3,300	27,573.33	24,651.00	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项停牌	59.72	2018-07-16	65.69	400	17,852.00	23,888.00	-
000967	盈峰环境	2018-05-18	重大事项停牌	8.70	2018-07-31	8.01	2,300	18,469.00	20,010.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.56	2,300	22,885.00	19,320.00	-
600399	*ST 抚钢	2018-01-31	重大事项停牌	5.50	-	-	3,500	19,355.00	19,250.00	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大事项停牌	6.62	-	-	2,900	17,226.00	19,198.00	-
600850	华东电脑	2018-05-14	重大事项停牌	18.99	2018-08-15	18.00	1,000	17,980.00	18,990.00	-
000545	金浦钛业	2018-06-11	重大事项停牌	3.76	-	-	4,900	24,415.36	18,424.00	-
002270	华明装备	2018-05-03	重大事项停牌	5.81	2018-07-03	5.23	3,000	17,896.00	17,430.00	-
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大事项停牌	2.02	2018-08-16	1.83	8,600	18,748.00	17,372.00	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大事项停牌	7.25	2018-08-06	6.53	2,380	18,496.00	17,255.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	1,100	20,108.00	16,797.00	-
300362	天翔环境	2018-06-08	重大事项停牌	9.68	-	-	1,700	17,714.00	16,456.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	15.03	-	-	1,000	18,960.00	15,030.00	-
002502	骅威文化	2018-06-05	重大事项停牌	5.82	-	-	2,500	18,492.00	14,550.00	-
002630	华西能源	2018-06-20	重大事项停牌	6.54	-	-	2,080	18,304.00	13,603.20	-

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	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	-
AAA以下	0.00	-
未评级	401,520.00	-
合计	401,520.00	-

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票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同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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9,897,480.06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3.13%，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	308,290.92	-	-	-	308,290.92
结算备付金	2,012.75	-	-	-	2,012.75
存出保证金	3,174.47	-	-	-	3,174.47
交易性金融资产	401,520.00	-	-	9,501,296.82	9,902,816.82
应收利息	-	-	-	3,622.58	3,622.58
应收申购款	-	-	-	22,173.11	22,173.11
资产总计	714,998.14	-	-	9,527,092.51	10,242,090.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,296.91	19,296.91
应付管理人报酬	-	-	-	4,287.84	4,287.84
应付托管费	-	-	-	857.55	857.55
应付销售服务费	-	-	-	872.13	872.13
应付交易费用	-	-	-	3,509.00	3,509.00
其他负债	-	-	-	74,946.47	74,946.47
负债总计	-	-	-	103,769.90	103,769.90
利率敏感度缺口	714,998.14	-	-	9,423,322.61	10,138,320.75

上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,881,591.96	-	-	-	11,881,591.96
交易性金融资产	-	-	-	11,238,680.00	11,238,680.00
应收利息	-	-	-	3,007.57	3,007.57
资产总计	11,881,591.96	-	-	11,241,687.57	23,123,279.53
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,206,470.17	11,206,470.17
应付管理人报酬	-	-	-	489.02	489.02
应付托管费	-	-	-	97.80	97.80
应付销售服务费	-	-	-	97.74	97.74
应付交易费用	-	-	-	8,093.70	8,093.70
其他负债	-	-	-	747.83	747.83
负债总计	-	-	-	11,215,996.26	11,215,996.26
利率敏感度缺口	11,881,591.96	-	-	25,691.31	11,907,283.27

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3.96%(2017年12月31日: 0.00%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	9,501,296.82	93.72	11,238,680.00	94.38
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	9,501,296.82	93.72	11,238,680.00	94.38

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	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	484,742.48	554,779.24
比较基准下降5%资产净值变动	-484,742.48	-554,779.24	

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9,184,106.62元，第二层次的余额为718,710.20元，无属于第三层次的余额（2017年12月31日：第一层次11,238,680.00元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

(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(2017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。

(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	9,501,296.82	92.77

	其中：股票	9,501,296.82	92.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	401,520.00	3.92
	其中：债券	401,520.00	3.92
	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	310,303.67	3.03
8	其他各项资产	28,970.16	0.28
9	合计	10,242,090.65	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	148,202.00	1.46
B	采矿业	286,961.00	2.83
C	制造业	4,987,550.98	49.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	250,616.50	2.47
E	建筑业	262,313.00	2.59
F	批发和零售业	348,452.60	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	253,411.00	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	529,762.60	5.23
J	金融业	1,571,488.00	15.50
K	房地产业	390,253.00	3.85

L	租赁和商务服务业	132,552.60	1.31
M	科学研究和技术服务业	16,410.24	0.16
N	水利、环境和公共设施 管理业	82,871.00	0.82
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	73,373.50	0.72
R	文化、体育和娱乐业	131,548.80	1.30
S	综合	35,530.00	0.35
	合计	9,501,296.82	93.72

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	601318	中国平安	5,000	292,900.00	2.89
2	600519	贵州茅台	300	219,438.00	2.16
3	000333	美的集团	2,300	120,106.00	1.18
4	601166	兴业银行	7,600	109,440.00	1.08
5	000651	格力电器	2,300	108,445.00	1.07
6	600276	恒瑞医药	1,300	98,488.00	0.97
7	600887	伊利股份	3,300	92,070.00	0.91
8	000858	五粮液	1,200	91,200.00	0.90
9	601288	农业银行	22,300	76,712.00	0.76
10	601328	交通银行	12,700	72,898.00	0.72
11	601398	工商银行	13,200	70,224.00	0.69
12	600030	中信证券	4,000	66,280.00	0.65
13	600016	民生银行	9,100	63,700.00	0.63

14	002415	海康威视	1,700	63,121.00	0.62
15	600104	上汽集团	1,800	62,982.00	0.62
16	600900	长江电力	3,400	54,876.00	0.54
17	601601	中国太保	1,700	54,145.00	0.53
18	002304	洋河股份	400	52,640.00	0.52
19	601668	中国建筑	9,520	51,979.20	0.51
20	000002	万科 A	2,100	51,660.00	0.51
21	601888	中国国旅	800	51,528.00	0.51
22	600000	浦发银行	5,100	48,756.00	0.48
23	600585	海螺水泥	1,400	46,872.00	0.46
24	600048	保利地产	3,800	46,360.00	0.46
25	601988	中国银行	12,800	46,208.00	0.46
26	000661	长春高新	200	45,540.00	0.45
27	603288	海天味业	600	44,184.00	0.44
28	300498	温氏股份	2,000	44,040.00	0.43
29	000725	京东方 A	12,200	43,188.00	0.43
30	600690	青岛海尔	2,200	42,372.00	0.42
31	000001	平安银行	4,500	40,905.00	0.40
32	600019	宝钢股份	5,000	38,950.00	0.38
33	600009	上海机场	700	38,836.00	0.38
34	600028	中国石化	5,900	38,291.00	0.38
35	000568	泸州老窖	600	36,516.00	0.36
36	002142	宁波银行	2,200	35,838.00	0.35
37	601818	光大银行	9,600	35,136.00	0.35
38	600837	海通证券	3,700	35,039.00	0.35
39	600518	康美药业	1,500	34,320.00	0.34
40	600436	片仔癀	300	33,579.00	0.33
41	601766	中国中车	4,300	33,110.00	0.33
42	601939	建设银行	5,000	32,750.00	0.32
43	000538	云南白药	300	32,088.00	0.32
44	002008	大族激光	600	31,914.00	0.31

45	600867	通化东宝	1,320	31,640.40	0.31
46	601229	上海银行	2,000	31,520.00	0.31
47	601169	北京银行	5,200	31,356.00	0.31
48	601009	南京银行	4,000	30,920.00	0.30
49	603589	口子窖	500	30,725.00	0.30
50	601088	中国神华	1,500	29,910.00	0.30
51	002442	龙星化工	2,700	29,619.00	0.29
52	300124	汇川技术	900	29,538.00	0.29
53	601211	国泰君安	2,000	29,480.00	0.29
54	300003	乐普医疗	800	29,344.00	0.29
55	603799	华友钴业	300	29,241.00	0.29
56	600196	复星医药	700	28,973.00	0.29
57	000963	华东医药	600	28,950.00	0.29
58	600703	三安光电	1,500	28,830.00	0.28
59	600660	福耀玻璃	1,100	28,281.00	0.28
60	002024	苏宁易购	2,000	28,160.00	0.28
61	601006	大秦铁路	3,400	27,914.00	0.28
62	002027	分众传媒	2,880	27,561.60	0.27
63	600352	浙江龙盛	2,300	27,485.00	0.27
64	002230	科大讯飞	850	27,259.50	0.27
65	000338	潍柴动力	3,100	27,125.00	0.27
66	601688	华泰证券	1,800	26,946.00	0.27
67	601899	紫金矿业	7,400	26,714.00	0.26
68	600570	恒生电子	500	26,475.00	0.26
69	002821	凯莱英	300	26,169.00	0.26
70	600741	华域汽车	1,100	26,092.00	0.26
71	002422	科伦药业	800	25,680.00	0.25
72	300059	东方财富	1,920	25,305.60	0.25
73	600031	三一重工	2,800	25,116.00	0.25
74	000616	海航投资	7,300	24,966.00	0.25
75	603883	老百姓	300	24,948.00	0.25

76	000650	仁和药业	3,900	24,804.00	0.24
77	002466	天齐锂业	500	24,795.00	0.24
78	002475	立讯精密	1,100	24,794.00	0.24
79	300347	泰格医药	400	24,748.00	0.24
80	601390	中国中铁	3,300	24,651.00	0.24
81	601918	新集能源	6,500	24,440.00	0.24
82	002044	美年健康	1,080	24,408.00	0.24
83	300015	爱尔眼科	750	24,217.50	0.24
84	600108	亚盛集团	8,300	23,987.00	0.24
85	300357	我武生物	600	23,922.00	0.24
86	603939	益丰药房	400	23,888.00	0.24
87	002594	比亚迪	500	23,840.00	0.24
88	000630	铜陵有色	10,500	23,205.00	0.23
89	600066	宇通客车	1,200	23,028.00	0.23
90	601225	陕西煤业	2,800	23,016.00	0.23
91	001979	招商蛇口	1,200	22,860.00	0.23
92	300170	汉得信息	1,400	22,736.00	0.22
93	002727	一心堂	700	22,715.00	0.22
94	300024	机器人	1,300	22,620.00	0.22
95	002236	大华股份	1,000	22,550.00	0.22
96	601628	中国人寿	1,000	22,520.00	0.22
97	601998	中信银行	3,600	22,356.00	0.22
98	600011	华能国际	3,500	22,260.00	0.22
99	002410	广联达	800	22,184.00	0.22
100	601198	东兴证券	1,700	22,168.00	0.22
101	601901	方正证券	3,300	22,077.00	0.22
102	000875	吉电股份	7,800	22,074.00	0.22
103	300339	润和软件	2,000	21,720.00	0.21
104	600050	中国联通	4,400	21,648.00	0.21
105	600111	北方稀土	1,900	21,622.00	0.21
106	000423	东阿阿胶	400	21,524.00	0.21

107	601336	新华保险	500	21,440.00	0.21
108	600298	安琪酵母	600	21,408.00	0.21
109	000552	靖远煤电	6,500	21,255.00	0.21
110	002460	赣锋锂业	550	21,219.00	0.21
111	002637	赞宇科技	2,100	21,210.00	0.21
112	600085	同仁堂	600	21,168.00	0.21
113	300144	宋城演艺	900	21,150.00	0.21
114	000895	双汇发展	800	21,128.00	0.21
115	300079	数码科技	5,800	21,112.00	0.21
116	600426	华鲁恒升	1,200	21,108.00	0.21
117	601012	隆基股份	1,260	21,029.40	0.21
118	002586	围海股份	3,000	21,000.00	0.21
119	002456	欧菲科技	1,300	20,969.00	0.21
120	600068	葛洲坝	2,900	20,909.00	0.21
121	300147	香雪制药	2,900	20,909.00	0.21
122	000677	恒天海龙	5,400	20,898.00	0.21
123	600372	中航电子	1,600	20,896.00	0.21
124	600015	华夏银行	2,800	20,860.00	0.21
125	000418	小天鹅 A	300	20,805.00	0.21
126	600340	华夏幸福	800	20,600.00	0.20
127	000009	中国宝安	4,200	20,580.00	0.20
128	600736	苏州高新	3,400	20,570.00	0.20
129	600115	东方航空	3,100	20,522.00	0.20
130	600999	招商证券	1,500	20,520.00	0.20
131	600919	江苏银行	3,200	20,512.00	0.20
132	600285	羚锐制药	2,300	20,493.00	0.20
133	000768	中航飞机	1,300	20,332.00	0.20
134	600219	南山铝业	7,500	20,325.00	0.20
135	600029	南方航空	2,400	20,280.00	0.20
136	600271	航天信息	800	20,216.00	0.20
137	600075	新疆天业	3,100	20,150.00	0.20

138	002022	科华生物	1,700	20,145.00	0.20
139	600325	华发股份	2,600	20,098.00	0.20
140	002228	合兴包装	4,200	20,034.00	0.20
141	000967	盈峰环境	2,300	20,010.00	0.20
142	600038	中直股份	500	19,995.00	0.20
143	000733	振华科技	1,500	19,965.00	0.20
144	002183	怡亚通	3,000	19,950.00	0.20
145	600315	上海家化	500	19,815.00	0.20
146	600176	中国巨石	1,920	19,641.60	0.19
147	300190	维尔利	3,600	19,620.00	0.19
148	000520	长航凤凰	6,400	19,584.00	0.19
149	603686	龙马环卫	800	19,552.00	0.19
150	600516	方大炭素	800	19,504.00	0.19
151	002179	中航光电	500	19,500.00	0.19
152	601311	骆驼股份	1,700	19,499.00	0.19
153	002215	诺普信	2,800	19,488.00	0.19
154	600824	益民集团	5,500	19,415.00	0.19
155	601989	中国重工	4,800	19,392.00	0.19
156	600628	新世界	2,700	19,386.00	0.19
157	000793	华闻传媒	2,300	19,320.00	0.19
158	002572	索菲亚	600	19,308.00	0.19
159	002007	华兰生物	600	19,296.00	0.19
160	600566	济川药业	400	19,276.00	0.19
161	600399	*ST抚钢	3,500	19,250.00	0.19
162	002332	仙琚制药	2,200	19,250.00	0.19
163	000751	锌业股份	5,900	19,234.00	0.19
164	600521	华海药业	720	19,216.80	0.19
165	601118	海南橡胶	2,900	19,198.00	0.19
166	600684	珠江实业	3,400	19,176.00	0.19
167	601929	吉视传媒	8,500	19,125.00	0.19
168	601607	上海医药	800	19,120.00	0.19

169	601933	永辉超市	2,500	19,100.00	0.19
170	000977	浪潮信息	800	19,080.00	0.19
171	002083	孚日股份	3,400	19,074.00	0.19
172	600850	华东电脑	1,000	18,990.00	0.19
173	000417	合肥百货	3,300	18,975.00	0.19
174	601186	中国铁建	2,200	18,964.00	0.19
175	600406	国电南瑞	1,200	18,960.00	0.19
176	002202	金风科技	1,500	18,960.00	0.19
177	000758	中色股份	4,200	18,900.00	0.19
178	002197	证通电子	2,300	18,860.00	0.19
179	600926	杭州银行	1,700	18,853.00	0.19
180	300408	三环集团	800	18,800.00	0.19
181	600114	东睦股份	1,924	18,797.48	0.19
182	300470	日机密封	400	18,788.00	0.19
183	000988	华工科技	1,300	18,785.00	0.19
184	000831	五矿稀土	1,600	18,624.00	0.18
185	002505	大康农业	8,700	18,618.00	0.18
186	600073	上海梅林	2,800	18,592.00	0.18
187	002294	信立泰	500	18,585.00	0.18
188	601155	新城控股	600	18,582.00	0.18
189	600487	亨通光电	840	18,522.00	0.18
190	002250	联化科技	2,100	18,522.00	0.18
191	600496	精工钢构	6,200	18,476.00	0.18
192	300136	信维通信	600	18,438.00	0.18
193	000545	金浦钛业	4,900	18,424.00	0.18
194	600489	中金黄金	2,700	18,414.00	0.18
195	600583	海油工程	3,500	18,410.00	0.18
196	002104	恒宝股份	2,700	18,387.00	0.18
197	600588	用友网络	750	18,382.50	0.18
198	603019	中科曙光	400	18,348.00	0.18
199	600240	华业资本	2,500	18,325.00	0.18

200	600648	外高桥	1,000	18,280.00	0.18
201	600220	江苏阳光	8,600	18,232.00	0.18
202	300001	特锐德	1,600	18,176.00	0.18
203	002325	洪涛股份	4,900	18,130.00	0.18
204	600730	中国高科	3,800	18,126.00	0.18
205	600535	天士力	700	18,074.00	0.18
206	600961	株冶集团	2,700	18,036.00	0.18
207	000529	广弘控股	3,200	17,984.00	0.18
208	300142	沃森生物	900	17,982.00	0.18
209	300039	上海凯宝	3,100	17,980.00	0.18
210	002206	海利得	3,600	17,964.00	0.18
211	600138	中青旅	900	17,937.00	0.18
212	002550	千红制药	3,200	17,888.00	0.18
213	002004	华邦健康	3,500	17,780.00	0.18
214	600229	城市传媒	2,200	17,776.00	0.18
215	601555	东吴证券	2,600	17,758.00	0.18
216	002172	澳洋科技	3,700	17,686.00	0.17
217	600834	申通地铁	2,500	17,675.00	0.17
218	002706	良信电器	2,700	17,658.00	0.17
219	002266	浙富控股	4,700	17,625.00	0.17
220	600169	太原重工	7,500	17,550.00	0.17
221	000060	中金岭南	3,600	17,496.00	0.17
222	600635	大众公用	4,700	17,484.00	0.17
223	000902	新洋丰	1,900	17,480.00	0.17
224	002078	太阳纸业	1,800	17,442.00	0.17
225	002308	威创股份	2,100	17,430.00	0.17
226	002270	华明装备	3,000	17,430.00	0.17
227	000908	景峰医药	3,700	17,427.00	0.17
228	603020	爱普股份	1,900	17,404.00	0.17
229	002284	亚太股份	3,000	17,400.00	0.17
230	600498	烽火通信	700	17,395.00	0.17

231	300296	利亚德	1,350	17,388.00	0.17
232	600022	山东钢铁	8,600	17,372.00	0.17
233	002271	东方雨虹	1,020	17,350.20	0.17
234	600958	东方证券	1,900	17,347.00	0.17
235	000837	秦川机床	3,500	17,325.00	0.17
236	000851	高鸿股份	3,220	17,323.60	0.17
237	600383	金地集团	1,700	17,323.00	0.17
238	002241	歌尔股份	1,700	17,323.00	0.17
239	600261	阳光照明	4,600	17,296.00	0.17
240	600557	康缘药业	1,400	17,290.00	0.17
241	600018	上港集团	2,900	17,284.00	0.17
242	000983	西山煤电	2,300	17,273.00	0.17
243	000669	金鸿控股	2,380	17,255.00	0.17
244	300342	天银机电	1,400	17,234.00	0.17
245	002345	潮宏基	2,000	17,200.00	0.17
246	000680	山推股份	5,000	17,200.00	0.17
247	002191	劲嘉股份	2,300	17,181.00	0.17
248	600256	广汇能源	4,200	17,178.00	0.17
249	000099	中信海直	2,700	17,172.00	0.17
250	300373	扬杰科技	600	17,160.00	0.17
251	002035	华帝股份	700	17,101.00	0.17
252	002169	智光电气	3,800	17,100.00	0.17
253	600109	国金证券	2,400	17,064.00	0.17
254	002672	东江环保	1,300	17,017.00	0.17
255	600655	豫园股份	1,800	17,010.00	0.17
256	600718	东软集团	1,300	16,978.00	0.17
257	002340	格林美	2,800	16,940.00	0.17
258	000063	中兴通讯	1,300	16,939.00	0.17
259	002064	华峰氨纶	4,100	16,933.00	0.17
260	600831	广电网络	2,800	16,856.00	0.17
261	002051	中工国际	1,100	16,797.00	0.17

262	600885	宏发股份	560	16,755.20	0.17
263	600547	山东黄金	700	16,744.00	0.17
264	002489	浙江永强	4,600	16,744.00	0.17
265	300070	碧水源	1,200	16,716.00	0.16
266	300005	探路者	4,300	16,684.00	0.16
267	000703	恒逸石化	1,120	16,665.60	0.16
268	001696	宗申动力	3,400	16,660.00	0.16
269	002145	中核钛白	4,500	16,560.00	0.16
270	000100	TCL 集团	5,700	16,530.00	0.16
271	300362	天翔环境	1,700	16,456.00	0.16
272	000750	国海证券	4,600	16,422.00	0.16
273	002155	湖南黄金	2,400	16,416.00	0.16
274	603018	中设集团	1,036	16,410.24	0.16
275	600284	浦东建设	3,360	16,396.80	0.16
276	600452	涪陵电力	600	16,386.00	0.16
277	601099	太平洋	7,000	16,380.00	0.16
278	600587	新华医疗	1,200	16,356.00	0.16
279	600606	绿地控股	2,500	16,350.00	0.16
280	002471	中超控股	5,300	16,324.00	0.16
281	603188	亚邦股份	1,600	16,320.00	0.16
282	000559	万向钱潮	2,400	16,320.00	0.16
283	000973	佛塑科技	4,200	16,296.00	0.16
284	601058	赛轮金宇	6,700	16,281.00	0.16
285	000728	国元证券	2,200	16,280.00	0.16
286	600418	江淮汽车	2,500	16,275.00	0.16
287	300201	海伦哲	3,600	16,236.00	0.16
288	000031	中粮地产	2,800	16,184.00	0.16
289	002500	山西证券	2,400	16,176.00	0.16
290	300370	安控科技	4,600	16,146.00	0.16
291	600223	鲁商置业	5,700	16,131.00	0.16
292	002224	三力士	2,700	16,092.00	0.16

293	002546	新联电子	4,300	16,039.00	0.16
294	002448	中原内配	2,300	16,031.00	0.16
295	002526	山东矿机	4,930	16,022.50	0.16
296	002138	顺络电子	1,000	16,010.00	0.16
297	000690	宝新能源	2,300	16,008.00	0.16
298	600368	五洲交通	4,995	15,984.00	0.16
299	600127	金健米业	4,800	15,936.00	0.16
300	300271	华宇软件	900	15,912.00	0.16
301	002772	众兴菌业	1,900	15,903.00	0.16
302	300301	长方集团	3,500	15,890.00	0.16
303	000503	国新健康	500	15,890.00	0.16
304	002673	西部证券	2,100	15,855.00	0.16
305	000887	中鼎股份	1,100	15,851.00	0.16
306	002657	中科金财	1,000	15,840.00	0.16
307	600478	科力远	3,100	15,810.00	0.16
308	600100	同方股份	1,800	15,804.00	0.16
309	600549	厦门钨业	1,040	15,787.20	0.16
310	002741	光华科技	1,000	15,780.00	0.16
311	002343	慈文传媒	840	15,766.80	0.16
312	300172	中电环保	2,800	15,764.00	0.16
313	000997	新大陆	1,000	15,750.00	0.16
314	000783	长江证券	2,900	15,747.00	0.16
315	600978	宜华生活	2,300	15,709.00	0.15
316	600004	白云机场	1,200	15,708.00	0.15
317	300422	博世科	1,100	15,675.00	0.15
318	600562	国睿科技	910	15,606.50	0.15
319	002223	鱼跃医疗	800	15,592.00	0.15
320	603117	万林股份	2,200	15,576.00	0.15
321	600021	上海电力	2,300	15,502.00	0.15
322	002491	通鼎互联	1,400	15,498.00	0.15
323	002364	中恒电气	1,600	15,488.00	0.15

324	300135	宝利国际	5,900	15,458.00	0.15
325	600756	浪潮软件	900	15,444.00	0.15
326	600373	中文传媒	1,200	15,420.00	0.15
327	002139	拓邦股份	2,700	15,363.00	0.15
328	300332	天壕环境	3,300	15,345.00	0.15
329	000040	东旭蓝天	1,500	15,150.00	0.15
330	600601	方正科技	5,500	15,125.00	0.15
331	600237	铜峰电子	4,000	15,120.00	0.15
332	000005	世纪星源	5,100	15,096.00	0.15
333	002244	滨江集团	2,900	15,080.00	0.15
334	600637	东方明珠	1,000	15,060.00	0.15
335	002273	水晶光电	1,170	15,057.90	0.15
336	600653	申华控股	7,800	15,054.00	0.15
337	002310	东方园林	1,000	15,030.00	0.15
338	600522	中天科技	1,700	14,977.00	0.15
339	600895	张江高科	1,300	14,950.00	0.15
340	601208	东材科技	3,600	14,868.00	0.15
341	002439	启明星辰	700	14,854.00	0.15
342	600531	豫光金铅	3,000	14,820.00	0.15
343	002317	众生药业	1,400	14,798.00	0.15
344	600990	四创电子	300	14,796.00	0.15
345	600363	联创光电	1,600	14,784.00	0.15
346	002162	悦心健康	4,700	14,758.00	0.15
347	600070	浙江富润	1,900	14,706.00	0.15
348	600116	三峡水利	2,200	14,696.00	0.14
349	300336	新文化	1,800	14,670.00	0.14
350	002185	华天科技	2,600	14,664.00	0.14
351	300315	掌趣科技	3,500	14,630.00	0.14
352	601600	中国铝业	3,800	14,592.00	0.14
353	002502	骅威文化	2,500	14,550.00	0.14
354	000413	东旭光电	2,400	14,544.00	0.14

355	000901	航天科技	1,450	14,529.00	0.14
356	603311	金海环境	1,300	14,508.00	0.14
357	600210	紫江企业	4,300	14,491.00	0.14
358	002561	徐家汇	1,600	14,480.00	0.14
359	002092	中泰化学	1,500	14,460.00	0.14
360	600153	建发股份	1,600	14,384.00	0.14
361	000652	泰达股份	4,600	14,352.00	0.14
362	601111	中国国航	1,600	14,224.00	0.14
363	600279	重庆港九	3,200	14,208.00	0.14
364	002067	景兴纸业	3,600	14,112.00	0.14
365	603000	人民网	1,700	14,110.00	0.14
366	600503	华丽家族	3,600	14,076.00	0.14
367	000400	许继电气	1,800	14,058.00	0.14
368	002334	英威腾	2,400	14,040.00	0.14
369	600692	亚通股份	2,000	14,020.00	0.14
370	000777	中核科技	1,500	14,010.00	0.14
371	002348	高乐股份	4,400	13,860.00	0.14
372	600571	信雅达	1,800	13,842.00	0.14
373	300050	世纪鼎利	2,300	13,800.00	0.14
374	000897	津滨发展	6,100	13,786.00	0.14
375	600343	航天动力	1,500	13,770.00	0.14
376	002237	恒邦股份	1,500	13,695.00	0.14
377	600251	冠农股份	2,500	13,675.00	0.13
378	000592	平潭发展	4,800	13,632.00	0.13
379	002630	华西能源	2,080	13,603.20	0.13
380	000920	南方汇通	2,200	13,574.00	0.13
381	600584	长电科技	800	13,552.00	0.13
382	300303	聚飞光电	4,900	13,426.00	0.13
383	300020	银江股份	1,400	13,314.00	0.13
384	002049	紫光国微	300	13,236.00	0.13
385	603005	晶方科技	600	13,212.00	0.13

386	002081	金螳螂	1,300	13,130.00	0.13
387	600410	华胜天成	1,500	13,125.00	0.13
388	002253	川大智胜	900	13,059.00	0.13
389	002479	富春环保	2,300	12,995.00	0.13
390	000544	中原环保	1,950	12,967.50	0.13
391	600677	航天通信	1,600	12,912.00	0.13
392	600825	新华传媒	3,100	12,896.00	0.13
393	002167	东方锆业	2,100	12,894.00	0.13
394	300017	网宿科技	1,200	12,852.00	0.13
395	600598	北大荒	1,400	12,824.00	0.13
396	000066	中国长城	1,800	12,798.00	0.13
397	300335	迪森股份	1,200	12,768.00	0.13
398	002079	苏州固锝	2,000	12,580.00	0.12
399	000068	华控赛格	4,100	12,464.00	0.12
400	002405	四维图新	600	12,150.00	0.12
401	601890	亚星锚链	2,800	12,124.00	0.12
402	600446	金证股份	1,100	12,111.00	0.12
403	002170	芭田股份	3,500	12,110.00	0.12
404	002465	海格通信	1,500	12,045.00	0.12
405	600512	腾达建设	5,200	11,700.00	0.12
406	002425	凯撒文化	2,400	11,400.00	0.11
407	603986	兆易创新	100	10,852.00	0.11

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	69,152.00	0.58

2	000661	长春高新	57,117.00	0.48
3	002284	亚太股份	43,686.00	0.37
4	002266	浙富控股	39,779.00	0.33
5	002092	中泰化学	37,912.00	0.32
6	600418	江淮汽车	37,161.00	0.31
7	002364	中恒电气	36,740.00	0.31
8	002304	洋河股份	35,907.00	0.30
9	601229	上海银行	35,442.00	0.30
10	300017	网宿科技	33,902.00	0.28
11	600990	四创电子	33,849.00	0.28
12	601989	中国重工	31,430.00	0.26
13	002442	龙星化工	30,066.00	0.25
14	600919	江苏银行	28,665.00	0.24
15	600583	海油工程	27,088.00	0.23
16	600372	中航电子	26,272.00	0.22
17	600325	华发股份	26,158.00	0.22
18	601998	中信银行	26,042.00	0.22
19	600628	新世界	25,985.00	0.22
20	002155	湖南黄金	25,904.00	0.22

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	77,987.00	0.65
2	300333	兆日科技	62,718.00	0.53
3	600123	兰花科创	50,382.00	0.42
4	300151	昌红科技	39,987.00	0.34
5	600769	祥龙电业	39,615.00	0.33
6	300018	中元股份	39,392.00	0.33

7	000722	湖南发展	38,745.00	0.33
8	000661	长春高新	37,989.00	0.32
9	600391	航发科技	35,045.00	0.29
10	600056	中国医药	34,960.00	0.29
11	002304	洋河股份	34,697.00	0.29
12	601866	中远海发	34,338.00	0.29
13	600388	龙净环保	34,126.00	0.29
14	600486	扬农化工	33,749.00	0.28
15	300352	北信源	33,744.00	0.28
16	002074	国轩高科	32,064.00	0.27
17	600673	东阳光科	31,988.00	0.27
18	002698	博实股份	31,538.00	0.26
19	002450	康得新	29,050.00	0.24
20	000552	靖远煤电	28,392.00	0.24

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	6,713,176.26
卖出股票收入（成交）总额	6,950,674.34

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	401,520.00	3.96
	其中：政策性金融债	401,520.00	3.96
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	401,520.00	3.96

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	4,000	401,520.00	3.96

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2017年7月26日，珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”或“格力电器”，股票代码：000651）收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》，认定徐自发作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，并对其采取出具警示函的监管措施。2017年10月19日，公司公告，获悉公司董事徐自发先生于2017年10月18日收到中国证券监督管理委员会

《调查通知书》，该通知书内容为“因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你立案调查，请予以配合。”

本基金投研认为，上述违规行为主要系公司董事徐自发所为，行政处罚和立案调查对象也是其本人。公司对此次董事违规行为的调查做出了迅速反应、积极配合并严格履行信披义务，将此次违规买卖所得收益全部收归公司所有，董事徐自发也于 2017 年 10 月 26 日辞职，不在公司担任任何职务，并承诺调查期间和做出调查结论后 6 个月内、辞职后 6 个月内不减持所持股份。此次事件无关公司经营活动和基本面变化，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	3,174.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,622.58
5	应收申购款	22,173.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,970.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
创金	179	31,730.79	5,000,700.14	88.04	679,111.20	11.96%

合信 国证A 股指 数A				%		
创金 合信 国证A 股指 数C	174	34,533.86	5,000,700.00	83.22 %	1,008,191.35	16.78%
合计	338	34,581.96	10,001,400.14	85.56 %	1,687,302.55	14.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信国证A股指数A	14,284.38	0.25%
	创金合信国证A股指数C	10,366.57	0.17%
	合计	24,650.95	0.21%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信国证A股指数A	0
	创金合信国证A股指数C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信国证A股指数A	0
	创金合信国证A股指数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	10,001,400.14	85.56%	10,001,400.14	85.56%	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	10,001,400.14	85.56%	10,001,400.14	85.56%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
基金合同生效日(2017年12月28日)基金份额总额	5,944,930.98	5,938,242.77
本报告期期初基金份额总额	5,944,930.98	5,938,242.77
本报告期基金总申购份额	326,926.86	676,375.72
减：本报告期基金总赎回份额	592,046.50	605,727.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	5,679,811.34	6,008,891.35
-------------	--------------	--------------

§ 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	13,663,850.60	100.00	9,839.85	100.00	-

创业 证券			%		%	
招商 证券	2	-	-	-	-	-
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。

本基金报告期内新增招商证券，广发证券，中信建投证券，英大证券，安信证券，中泰证券、长江证券7家券商的13个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	401,320.00	100.00%	2,110,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-01-02
2	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、证券时报	2018-01-24
3	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、证券时报	2018-01-29
4	创金合信国证A股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、证券时报	2018-02-01

5	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-03-02
6	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2018年第一季度报告	公司官网、中国证券报、证券时报	2018-04-19
7	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、证券时报	2018-06-16
8	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、证券时报	2018-06-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101 - 20180630	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	85.56%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国证A股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