

# 创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示

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

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信中证1000增强	
基金主代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	58,934,800.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份额总额	27,019,851.67份	31,914,948.65份

### 2.2 基金产品说明

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

--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	贺倩
	联系电话	0755-23838908	010-66060069
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95599
传真		0755-25832571	010-68121816

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年12月22日（基金合同生效日）-2016年12月31日	
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
本期已实现收益	-14,374,051.88	-8,398,136.00	-4,982,142.06	-213,418.70	-2,327.16	-2,613.13
本期利润	-14,820,436.86	-8,434,091.20	-6,204,641.10	-188,997.31	-56,916.20	-58,007.51

加权平均基金份额本期利润	-0.2546	-0.2978	-0.0309	-0.0272	-0.0113	-0.0114
本期基金份额净值增长率	-23.70%	-23.76%	-1.31%	-1.34%	-1.13%	-1.14%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.3093	-0.3102	-0.0269	-0.0272	-0.0113	-0.0114
期末基金资产净值	20,116,169.03	23,730,901.58	205,305,541.73	10,001,754.96	4,965,656.23	5,048,168.18
期末基金份额净值	0.7445	0.7436	0.9757	0.9754	0.9887	0.9886

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证1000增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.19%	1.76%	-10.58%	1.80%	3.39%	-0.04%
过去六个月	-12.63%	1.50%	-19.98%	1.54%	7.35%	-0.04%

过去一年	-23.70%	1.46%	-35.26%	1.48%	11.56%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.55%	1.21%	-46.61%	1.24%	21.06%	-0.03%

## 创金合信中证1000增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.25%	1.76%	-10.58%	1.80%	3.33%	-0.04%
过去六个月	-12.73%	1.50%	-19.98%	1.54%	7.25%	-0.04%
过去一年	-23.76%	1.46%	-35.26%	1.48%	11.50%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.64%	1.21%	-46.61%	1.24%	20.97%	-0.03%

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

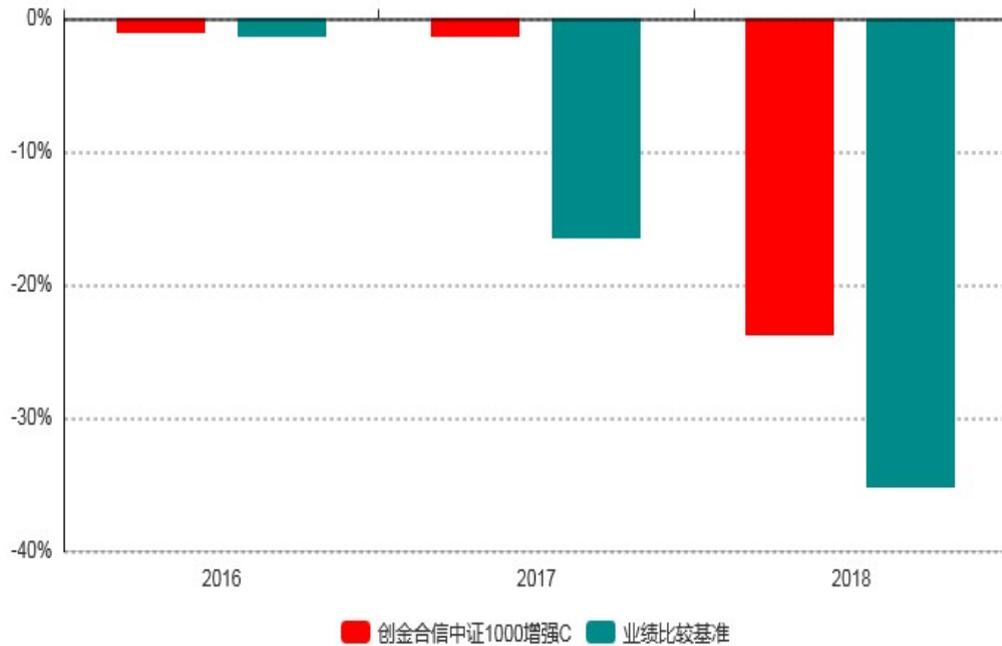
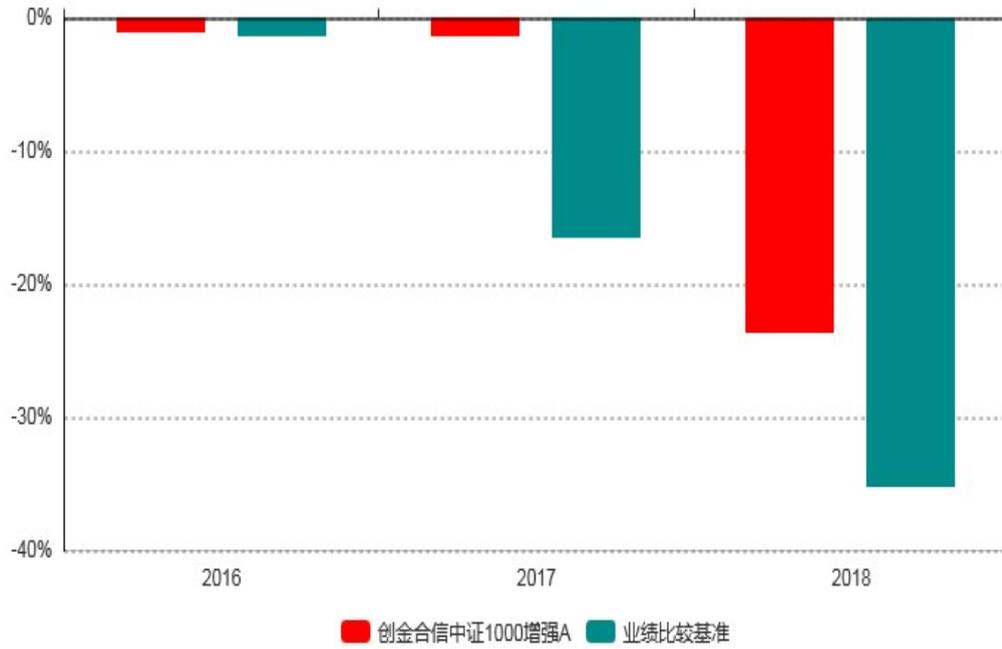
创金合信中证1000增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月22日-2018年12月31日)



创金合信中证1000增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月22日-2018年12月31日)



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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2016年12月22日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行11只公募基金。截至2018年12月31日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品8只、债券型产品12只、股票型产品9只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约150.47亿元。

#### 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		
庞世恩	本基金基金经理	2016-12-22	2018-08-31	7年	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，2016年12月至2018年8月担任本基金基金经理。

程志田	本基金基金经理、量化投资部总监	2016-12-22	-	12年	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。
-----	-----------------	------------	---	-----	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、

《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

#### 2、交易执行的内部控制

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

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

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

#### 4、公平交易监控

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控

及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，本基金与其他基金构成同日反向且交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共80次，本基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信中证1000增强A基金份额净值为0.7445元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-23.70%，同期业绩比较基准收益率为-35.26%；截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为0.7436元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-23.76%，同期业绩比较基准收益率为-35.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济增长前景趋弱叠加中美贸易摩擦的背景下，出口外需受到一定抑制。2019年的宏观经济不确定性增强，企业利润回落压力加大，经济下行风险仍然存在。从股票市场主要指数的估值水平来看，当前估值均处于历史低位，下行空间有限，2019年或有结构性行情出现。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-创金合信基金管理有限公司2018年1月1日至2018年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	801,785.36	3,656,874.22
结算备付金	696,932.85	3,011,126.34
存出保证金	33,180.97	110,107.64
交易性金融资产	42,451,516.03	207,208,031.86
其中：股票投资	40,222,935.23	196,110,171.06
基金投资	-	-
债券投资	2,228,580.80	11,097,860.80
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,993,099.38
应收利息	61,785.93	65,650.24
应收股利	-	-
应收申购款	125,567.78	615,783.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	44,170,768.92	216,660,673.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-

衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	25,546.94	20,455.61
应付管理人报酬	29,990.46	144,506.50
应付托管费	5,623.23	27,094.96
应付销售服务费	3,993.92	1,613.21
应付交易费用	88,543.41	1,014,705.99
应交税费	0.35	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	170,000.00	145,000.62
负债合计	323,698.31	1,353,376.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	58,934,800.32	220,669,622.69
未分配利润	-15,087,729.71	-5,362,326.00
所有者权益合计	43,847,070.61	215,307,296.69
负债和所有者权益总计	44,170,768.92	216,660,673.58

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额58,934,800.32份，其中下属A类基金份额27,019,851.67份，C类基金份额31,914,948.65份。下属A类基金份额净值0.7445元，C类基金份额净值0.7436元。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	-18,251,396.46	2,178,924.03
1. 利息收入	184,686.84	131,154.39

其中：存款利息收入	47,693.62	121,270.41
债券利息收入	135,838.71	9,883.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,154.51	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-18,057,855.68	3,224,768.48
其中：股票投资收益	-18,510,212.48	1,929,523.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	21,106.66	13,125.03
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	431,250.14	1,282,119.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-482,340.18	-1,198,077.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	104,112.56	21,078.81
<b>减：二、费用</b>	<b>5,003,131.60</b>	<b>8,572,562.44</b>
1. 管理人报酬	630,834.22	1,623,015.99
2. 托管费	118,281.34	304,315.56
3. 销售服务费	48,739.29	13,562.33
4. 交易费用	3,977,743.62	6,450,010.74
5. 利息支出	21,729.33	-
其中：卖出回购金融资产支出	21,729.33	-
6. 税金及附加	0.72	-

7. 其他费用	205, 803. 08	181, 657. 82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-23, 254, 528. 06	-6, 393, 638. 41
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-23, 254, 528. 06	-6, 393, 638. 41

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	220, 669, 622. 6 9	-5, 362, 326. 00	215, 307, 296. 69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23, 254, 528. 0 6	-23, 254, 528. 06
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）	-161, 734, 822. 37	13, 529, 124. 35	-148, 205, 698. 02
其中：1. 基金申购款	99, 011, 771. 99	-10, 059, 264. 8 6	88, 952, 507. 13
2. 基金赎回款	-260, 746, 594. 36	23, 588, 389. 21	-237, 158, 205. 15
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）	58, 934, 800. 32	-15, 087, 729. 7 1	43, 847, 070. 61
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,128,831.96	-115,007.55	10,013,824.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,393,638.41	-6,393,638.41
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)	210,540,790.73	1,146,319.96	211,687,110.69
其中：1. 基金申购款	220,370,635.75	905,967.13	221,276,602.88
2. 基金赎回款	-9,829,845.02	240,352.83	-9,589,492.19
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)	220,669,622.69	-5,362,326.00	215,307,296.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,333.36份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于2018年12月31日，本基金的基金资产净值为43,847,070.61元，且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 关联方关系

##### 7.4.7.1 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。

##### 7.4.7.2 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
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人
第一创业证券股份有限公司(“第一创业证	基金管理人的股东、基金代销机构

券”)	
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日	
	成交金额	占当期股票成 交总额的比例	成交金额	占当期股票成 交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	3,291,12 4,477.15	81.85%	4,202,81 8,751.90	59.58%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年1 2月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日	
	债券买卖 成交金额	占当期债券买 卖成交总额的 比例	成交金 额	占当期债券买 卖成交总额的 比例
第一创业证券股份有限公 司	13,400,8 79.65	83.27%	11,469 ,138.0 1	100.00%

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年12月31日	
	债券回购 成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交 金额	占当期债券回购 成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	78,500,0 00.00	75.85%	-	-

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期佣 金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,381,2 18.55	89.63%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期佣 金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	1,764,4 18.52	73.93%	1,014,705 .99	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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年01月01日至201	2017年01月01日至201

	8年12月31日	7年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	630,834.22	1,623,015.99
其中：支付销售机构的客户维护费	89,288.17	17,620.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	118,281.34	304,315.56

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.8.2.3 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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信直销	0.00	32,638.78	32,638.78
合计	0.00	32,638.78	32,638.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信直销	0.00	9,777.42	9,777.42
合计	0.00	9,777.42	9,777.42

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C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类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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、休息日等，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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信中证1000增强A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01 日至2018年12 月31日	上年度可比期 间 2017年01月01 日至2017年12 月31日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期初持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.51%	2.38%

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01 日至2018年12 月31日	上年度可比期 间 2017年01月01 日至2017年12 月31日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期初持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,166.66	5,000,166.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.67%	48.76%

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 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 12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年1 2月31日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国农业银行股份有限公司	801,785.36	13,874.01	3,656,874.22	78,276.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110050	佳都转债	2018-12-19	2019-01-21	新发流通受限	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.00	-

##### 7.4.9.2 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
000708	大冶特钢	2018-12-	重大事项	8.77	2019-01-	9.65	800	6,944.00	7,016.00	-

		25	停牌		03					
--	--	----	----	--	----	--	--	--	--	--

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 7.4.10 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12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为40,239,864.03元，属于第二层次的余额为2,211,652.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次184,733,660.40元，第二层次22,474,371.46元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券

公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	40,222,935.23	91.06
	其中：股票	40,222,935.23	91.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,228,580.80	5.05
	其中：债券	2,228,580.80	5.05
	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	1,498,718.21	3.39
8	其他各项资产	220,534.68	0.50
9	合计	44,170,768.92	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	457,320.00	1.04
B	采矿业	829,834.00	1.89
C	制造业	20,798,213.22	47.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,136,021.00	2.59
E	建筑业	770,761.00	1.76
F	批发和零售业	1,311,187.00	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	835,907.70	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,521,778.00	8.03
J	金融业	115,536.60	0.26
K	房地产业	1,373,050.00	3.13
L	租赁和商务服务业	178,928.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	341,760.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	593,611.00	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,988.00	0.10
Q	卫生和社会工作	63,855.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	671,708.00	1.53
S	综合	39,120.00	0.09

	合计	33,083,578.52	75.45
--	----	---------------	-------

## 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	94,170.00	0.21
B	采矿业	43,979.00	0.10
C	制造业	4,319,480.00	9.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	241,276.00	0.55
E	建筑业	278,453.00	0.64
F	批发和零售业	511,361.52	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	255,839.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	435,701.75	0.99
J	金融业	61,724.44	0.14
K	房地产业	324,693.00	0.74
L	租赁和商务服务业	134,077.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	13,086.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	168,260.00	0.38
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	218,863.00	0.50
S	综合	38,393.00	0.09
	合计	7,139,356.71	16.28

### 8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600873	梅花生物	39,100	165,002.00	0.38
2	002138	顺络电子	11,500	159,160.00	0.36
3	000977	浪潮信息	9,800	156,016.00	0.36
4	300285	国瓷材料	8,500	141,695.00	0.32
5	000883	湖北能源	37,800	138,726.00	0.32
6	002383	合众思壮	11,600	137,228.00	0.31
7	600252	中恒集团	53,200	136,724.00	0.31
8	600675	中华企业	24,200	135,036.00	0.31
9	002376	新北洋	8,800	134,992.00	0.31
10	600745	闻泰科技	6,300	133,119.00	0.30

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

#### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000719	中原传媒	5,500	43,285.00	0.10
2	600820	隧道股份	6,800	42,568.00	0.10
3	002475	立讯精密	3,000	42,180.00	0.10
4	600510	黑牡丹	6,900	41,814.00	0.10
5	300403	汉宇集团	8,300	41,666.00	0.10

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

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601799	星宇股份	9,970,643.00	4.63
2	600622	光大嘉宝	9,259,099.58	4.30
3	600567	山鹰纸业	8,794,579.90	4.08
4	300271	华宇软件	8,556,007.71	3.97
5	000818	航锦科技	8,184,314.71	3.80
6	002449	国星光电	7,751,396.00	3.60
7	002429	兆驰股份	7,349,609.50	3.41
8	002025	航天电器	7,339,492.69	3.41
9	002383	合众思壮	7,311,698.34	3.40
10	002080	中材科技	7,293,559.60	3.39
11	600486	扬农化工	7,139,526.35	3.32
12	601126	四方股份	7,128,962.54	3.31
13	000040	东旭蓝天	7,096,607.89	3.30
14	600261	阳光照明	6,768,629.00	3.14
15	000591	太阳能	6,765,937.80	3.14
16	601222	林洋能源	6,748,248.00	3.13
17	600252	中恒集团	6,444,342.00	2.99
18	600269	赣粤高速	6,432,871.00	2.99
19	600470	六国化工	6,408,473.29	2.98
20	000650	仁和药业	6,362,520.00	2.96
21	600803	新奥股份	6,295,865.62	2.92
22	603898	好莱客	6,267,253.00	2.91
23	300098	高新兴	6,255,603.03	2.91
24	600667	太极实业	6,219,189.00	2.89
25	600963	岳阳林纸	6,157,589.81	2.86
26	002247	聚力文化	6,062,611.00	2.82
27	600491	龙元建设	6,057,552.00	2.81
28	600057	厦门象屿	6,035,588.40	2.80

29	002067	景兴纸业	6,033,760.00	2.80
30	600114	东睦股份	5,918,004.62	2.75
31	300157	恒泰艾普	5,901,794.56	2.74
32	000042	中洲控股	5,815,926.88	2.70
33	000683	远兴能源	5,775,752.00	2.68
34	600629	华建集团	5,717,399.12	2.66
35	600775	南京熊猫	5,716,124.36	2.65
36	600331	宏达股份	5,694,457.00	2.64
37	600172	黄河旋风	5,638,401.80	2.62
38	603368	柳药股份	5,625,819.20	2.61
39	300050	世纪鼎利	5,620,597.00	2.61
40	300485	赛升药业	5,620,040.00	2.61
41	603979	金诚信	5,619,688.92	2.61
42	300297	蓝盾股份	5,600,998.02	2.60
43	600508	上海能源	5,586,640.53	2.59
44	000065	北方国际	5,544,529.01	2.58
45	600686	金龙汽车	5,541,962.00	2.57
46	600323	瀚蓝环境	5,537,584.52	2.57
47	000553	沙隆达 A	5,453,250.00	2.53
48	600063	皖维高新	5,405,362.44	2.51
49	002543	万和电气	5,398,454.90	2.51
50	000525	红太阳	5,375,358.00	2.50
51	002483	润邦股份	5,369,242.40	2.49
52	600123	兰花科创	5,308,804.00	2.47
53	000860	顺鑫农业	5,266,625.00	2.45
54	600035	楚天高速	5,265,126.00	2.45
55	300177	中海达	5,232,047.58	2.43
56	300349	金卡智能	5,178,702.84	2.41
57	300447	全信股份	5,174,689.10	2.40
58	000925	众合科技	5,169,921.19	2.40
59	002484	江海股份	5,169,081.80	2.40

60	600143	金发科技	5,133,767.00	2.38
61	000601	韶能股份	5,109,043.75	2.37
62	002185	华天科技	5,100,268.00	2.37
63	600548	深高速	5,092,443.00	2.37
64	002372	伟星新材	5,062,689.00	2.35
65	600551	时代出版	5,039,311.81	2.34
66	300347	泰格医药	5,025,225.22	2.33
67	600742	一汽富维	5,003,712.36	2.32
68	002393	力生制药	4,978,708.00	2.31
69	300307	慈星股份	4,930,916.00	2.29
70	601666	平煤股份	4,920,080.68	2.29
71	300114	中航电测	4,882,024.75	2.27
72	002341	新纶科技	4,864,281.11	2.26
73	000733	振华科技	4,831,296.00	2.24
74	002680	*ST长生	4,785,066.00	2.22
75	000030	富奥股份	4,785,039.14	2.22
76	002597	金禾实业	4,756,450.68	2.21
77	600777	新潮能源	4,670,179.00	2.17
78	000159	国际实业	4,664,315.64	2.17
79	600285	羚锐制药	4,648,193.03	2.16
80	002507	涪陵榨菜	4,646,860.72	2.16
81	600577	精达股份	4,645,593.00	2.16
82	300054	鼎龙股份	4,501,699.20	2.09
83	000059	华锦股份	4,478,487.00	2.08
84	600382	广东明珠	4,475,647.64	2.08
85	002433	太安堂	4,470,312.00	2.08
86	600502	安徽水利	4,445,411.00	2.06
87	600101	明星电力	4,443,722.00	2.06
88	603328	依顿电子	4,442,997.94	2.06
89	600674	川投能源	4,421,540.92	2.05
90	300219	鸿利智汇	4,392,784.00	2.04

91	600681	百川能源	4,384,021.00	2.04
92	002097	山河智能	4,364,489.00	2.03
93	600255	梦舟股份	4,357,851.00	2.02
94	002091	江苏国泰	4,357,281.59	2.02
95	601107	四川成渝	4,348,897.00	2.02
96	300232	洲明科技	4,314,051.12	2.00

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601799	星宇股份	9,929,027.04	4.61
2	600486	扬农化工	9,563,181.65	4.44
3	600567	山鹰纸业	9,199,644.00	4.27
4	300271	华宇软件	9,098,545.37	4.23
5	600622	光大嘉宝	8,777,603.37	4.08
6	002449	国星光电	8,642,540.54	4.01
7	000818	航锦科技	8,175,092.00	3.80
8	000042	中洲控股	8,102,991.57	3.76
9	002372	伟星新材	7,979,893.82	3.71
10	600114	东睦股份	7,977,336.04	3.71
11	002247	聚力文化	7,895,236.32	3.67
12	600686	金龙汽车	7,687,494.55	3.57
13	000553	沙隆达 A	7,520,634.00	3.49
14	600261	阳光照明	7,498,792.55	3.48
15	600491	龙元建设	7,276,130.00	3.38
16	002483	润邦股份	7,241,568.82	3.36
17	002025	航天电器	7,230,034.00	3.36
18	002429	兆驰股份	7,226,448.00	3.36
19	002383	合众思壮	7,116,648.00	3.31

20	600548	深高速	7,061,084.41	3.28
21	601126	四方股份	7,008,326.64	3.26
22	002080	中材科技	6,966,817.40	3.24
23	600323	瀚蓝环境	6,944,902.30	3.23
24	603368	柳药股份	6,863,029.00	3.19
25	000040	东旭蓝天	6,811,378.40	3.16
26	603898	好莱客	6,808,017.80	3.16
27	300485	赛升药业	6,758,992.20	3.14
28	300447	全信股份	6,703,764.20	3.11
29	000591	太阳能	6,627,065.00	3.08
30	000921	海信家电	6,597,192.65	3.06
31	603979	金诚信	6,584,800.54	3.06
32	600285	羚锐制药	6,561,622.06	3.05
33	600331	宏达股份	6,540,469.25	3.04
34	300219	鸿利智汇	6,521,260.00	3.03
35	600173	卧龙地产	6,458,648.70	3.00
36	600508	上海能源	6,407,504.46	2.98
37	600470	六国化工	6,402,231.36	2.97
38	000065	北方国际	6,387,600.50	2.97
39	000525	红太阳	6,383,267.40	2.96
40	300050	世纪鼎利	6,327,981.30	2.94
41	601107	四川成渝	6,311,684.32	2.93
42	601666	平煤股份	6,277,585.00	2.92
43	600269	赣粤高速	6,270,424.00	2.91
44	601222	林洋能源	6,237,584.00	2.90
45	300098	高新兴	6,212,198.05	2.89
46	600252	中恒集团	6,187,947.85	2.87
47	000650	仁和药业	6,109,547.25	2.84
48	600667	太极实业	6,107,298.00	2.84
49	600963	岳阳林纸	6,098,221.04	2.83
50	600337	美克家居	6,052,695.99	2.81

51	600803	新奥股份	6,027,672.14	2.80
52	600057	厦门象屿	5,987,260.92	2.78
53	002067	景兴纸业	5,944,595.06	2.76
54	300194	福安药业	5,795,281.00	2.69
55	002121	科陆电子	5,767,943.00	2.68
56	600775	南京熊猫	5,713,055.00	2.65
57	600736	苏州高新	5,616,781.35	2.61
58	300297	蓝盾股份	5,616,242.00	2.61
59	000683	远兴能源	5,614,318.20	2.61
60	600035	楚天高速	5,599,643.20	2.60
61	600629	华建集团	5,588,375.80	2.60
62	300323	华灿光电	5,565,901.00	2.59
63	600172	黄河旋风	5,516,042.60	2.56
64	600101	明星电力	5,508,127.60	2.56
65	600582	天地科技	5,492,852.00	2.55
66	000860	顺鑫农业	5,428,848.93	2.52
67	002543	万和电气	5,363,061.83	2.49
68	002139	拓邦股份	5,356,820.00	2.49
69	300232	洲明科技	5,339,261.70	2.48
70	002100	天康生物	5,321,803.40	2.47
71	600063	皖维高新	5,278,886.83	2.45
72	300177	中海达	5,270,661.00	2.45
73	600105	永鼎股份	5,263,433.12	2.44
74	603669	灵康药业	5,254,686.08	2.44
75	600742	一汽富维	5,233,011.20	2.43
76	300157	恒泰艾普	5,215,480.00	2.42
77	600123	兰花科创	5,146,465.00	2.39
78	002680	*ST长生	5,105,919.63	2.37
79	600824	益民集团	5,084,763.95	2.36
80	300114	中航电测	5,053,364.50	2.35
81	000925	众合科技	5,046,552.05	2.34

82	600990	四创电子	5,044,270.54	2.34
83	000902	新洋丰	5,038,303.12	2.34
84	600551	时代出版	5,031,004.20	2.34
85	300347	泰格医药	5,023,117.24	2.33
86	002484	江海股份	4,998,999.26	2.32
87	300349	金卡智能	4,996,276.80	2.32
88	002185	华天科技	4,966,411.92	2.31
89	002376	新北洋	4,960,095.00	2.30
90	600219	南山铝业	4,949,319.00	2.30
91	000719	中原传媒	4,932,372.28	2.29
92	600143	金发科技	4,903,483.00	2.28
93	002597	金禾实业	4,903,245.00	2.28
94	002518	科士达	4,848,349.90	2.25
95	000601	韶能股份	4,835,720.10	2.25
96	300438	鹏辉能源	4,810,384.20	2.23
97	601900	南方传媒	4,765,244.20	2.21
98	600502	安徽水利	4,744,699.60	2.20
99	300036	超图软件	4,727,650.36	2.20
100	002507	涪陵榨菜	4,717,263.85	2.19
101	300047	天源迪科	4,712,996.15	2.19
102	000070	特发信息	4,671,841.38	2.17
103	002393	力生制药	4,666,199.00	2.17
104	000059	华锦股份	4,641,045.00	2.16
105	000030	富奥股份	4,624,067.40	2.15
106	002341	新纶科技	4,624,041.05	2.15
107	002737	葵花药业	4,612,658.00	2.14
108	000733	振华科技	4,539,285.00	2.11
109	300307	慈星股份	4,527,247.00	2.10
110	600552	凯盛科技	4,526,976.58	2.10
111	601137	博威合金	4,482,954.62	2.08
112	000159	国际实业	4,480,232.00	2.08

113	600577	精达股份	4,406,228.00	2.05
114	300118	东方日升	4,399,503.50	2.04
115	600674	川投能源	4,382,167.00	2.04
116	002433	太安堂	4,380,144.00	2.03
117	300336	新文化	4,373,247.08	2.03
118	603328	依顿电子	4,362,430.06	2.03
119	600777	新潮能源	4,341,479.00	2.02
120	600382	广东明珠	4,321,604.00	2.01
121	600681	百川能源	4,315,342.00	2.00

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,942,892,200.12
卖出股票收入（成交）总额	2,079,764,895.29

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,199,636.00	5.02
	其中：政策性金融债	2,199,636.00	5.02
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）	28,944.80	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,228,580.80	5.08

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	21,900	2,199,636.00	5.02
2	110047	山鹰转债	240	23,944.80	0.05
3	110050	佳都转债	50	5,000.00	0.01

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

2018年8月29日，湖北能源集团股份有限公司（以下简称公司）收到中国证券监督管理委员会湖北监管局《关于对湖北能源集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》，被认为公司存在公司日常管理和财务系统未独立于控股股东和公司年报中关于独立性的披露不准确两条违反《上市公司信息披露管理办法》的情形。公司被要求责令改正，并按要求制定切实可行的整改计划，在规定时间内向湖北证监局提交书面整改报告，切实整改相关问题。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，湖北能源公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。该公司作为全国

大型电力、热力生产和供应业企业之一，目前估值处于历史底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对湖北能源进行了投资。

山东新北洋信息技术股份有限公司（以下简称“新北洋”或“公司”）于近日收到中国证券监督管理委员会山东监管局（以下简称“山东证监局”）行政监管措施决定书，被认为公司存在内幕信息知情人登记不完整和未制作重大事项进程备忘录等问题，具体而言包括内幕信息知情人登记不完整、部分涉及内幕信息事项未登记和未建立重大事项进程备忘录三项问题，违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，被山东证监局出具警示函。

本基金投研人员分析认为，公司在收到上述决定书后，公司董事会和管理层对上述问题高度重视，并以整改为契机，加强了对各证券法律法规的学习，提高了信息披露质量。该事件发生后该公司经营状况正常。该公司作为中国电子信息行业创新能力五十强企业，拥有“国家认定企业技术中心”“专用打印技术及集成国家地方联合工程实验室”，连续多年荣膺CCTV中国上市公司“创新十强”，目前估值处于历史底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对新北洋进行了投资。

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,180.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,785.93
5	应收申购款	125,567.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	220,534.68

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数(户 )	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总 份额 比例	持有 份额	占总份额比例
创金 合信 中证1 000增 强A	1,072	25,205.09	5,000 ,166. 70	18.51 %	22,01 9,684 .97	81.49%
创金 合信 中证1 000增 强C	812	39,304.12	12,72 4,250 .12	39.87 %	19,19 0,698 .53	60.13%
合计	1,824	32,310.75	17,72 4,416 .82	30.07 %	41,21 0,383 .50	69.93%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信中证1000增强A	70,069.78	0.26%
	创金合信中证1000增强C	59,801.57	0.19%
	合计	129,871.35	0.22%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,000,333.36	16.97%	10,000,333.36	16.97%	36月
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,333.36	16.97%	10,000,333.36	16.97%	36月

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证1000增强 A	创金合信中证1000增强 C
基金合同生效日(2016年12月22日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	210,415,694.76	10,253,927.93
本报告期基金总申购份额	27,549,402.41	71,462,369.58
减：本报告期基金总赎回份额	210,945,245.50	49,801,348.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,019,851.67	31,914,948.65

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动，本基金托管行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所,本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用60,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为2年。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金元证券	2	729,926,724.13	18.15%	159,772.42	10.37%	-
第一创业证券	2	3,291,124,477.15	81.85%	1,381,218.55	89.63%	-

注:交易单元的选择标准和程序:

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

(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

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

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

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

本基金本报告期内无交易单元变更。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金元证券	2,692,640.00	16.73%	25,000.00	24.15%	-	-	-	-
第一创业证券	13,400,879.65	83.27%	78,500.00	75.85%	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过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 - 20180326	158,930,244.65	0.00	158,930,244.65	0.00	0.00%
	2	20180208 - 20180327	39,847,579.20	0.00	39,847,579.20	0.00	0.00%
	3	20180328 - 20180412, 20180828 - 20181114, 20181120 - 20181121	10,000,333.36	0.00	0.00	10,000,333.36	16.97%

	4	20180328 - 20180708	0.00	20,8 39,5 64.7 5	20,8 39,5 64.7 5	0.00	0.00%
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</p> <p>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</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年三月二十九日