

# 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

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。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
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	92
8.7 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	93
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	93
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	93
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	93
8.12 投资组合报告附注 .....	93
§9 基金份额持有人信息 .....	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	95
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 .....	96
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	96
§10 开放式基金份额变动 .....	96
§11 重大事件揭示 .....	97
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	97
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.....	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	97
11.4 基金投资策略的改变 .....	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	97
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.....	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	97
11.8 其他重大事件 .....	98
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	103
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.....	103
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	104
§13 备查文件目录 .....	104
13.1 备查文件目录 .....	104
13.2 存放地点 .....	105
13.3 查阅方式.....	105

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金	
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
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）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518000	100031
法定代表人		刘学民	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

注：本基金自2019年1月19日起信息披露报纸由《证券时报》变更为《上海证券报》。

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业

	(特殊普通合伙)	广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路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1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
本期加权平均净值利润率	-27.55%	-34.31%	-3.16%	-2.78%	-1.14%	-1.15%
本期基金份额净值增长率	-23.70%	-23.76%	-1.31%	-1.34%	-1.13%	-1.14%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	-8,356,396.21	-9,899,925.48	-5,662,246.40	-279,083.96	-56,903.46	-58,104.09
期末可供	-0.3093	-0.3102	-0.0269	-0.0272	-0.0113	-0.0114

分配基金份额利润						
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年末		2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	-25.55%	-25.64%	-2.43%	-2.46%	-1.13%	-1.14%

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。

### 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	-25.55%	1.21%	-46.61%	1.24%	21.06%	-0.03%

合同生效起至今						
---------	--	--	--	--	--	--

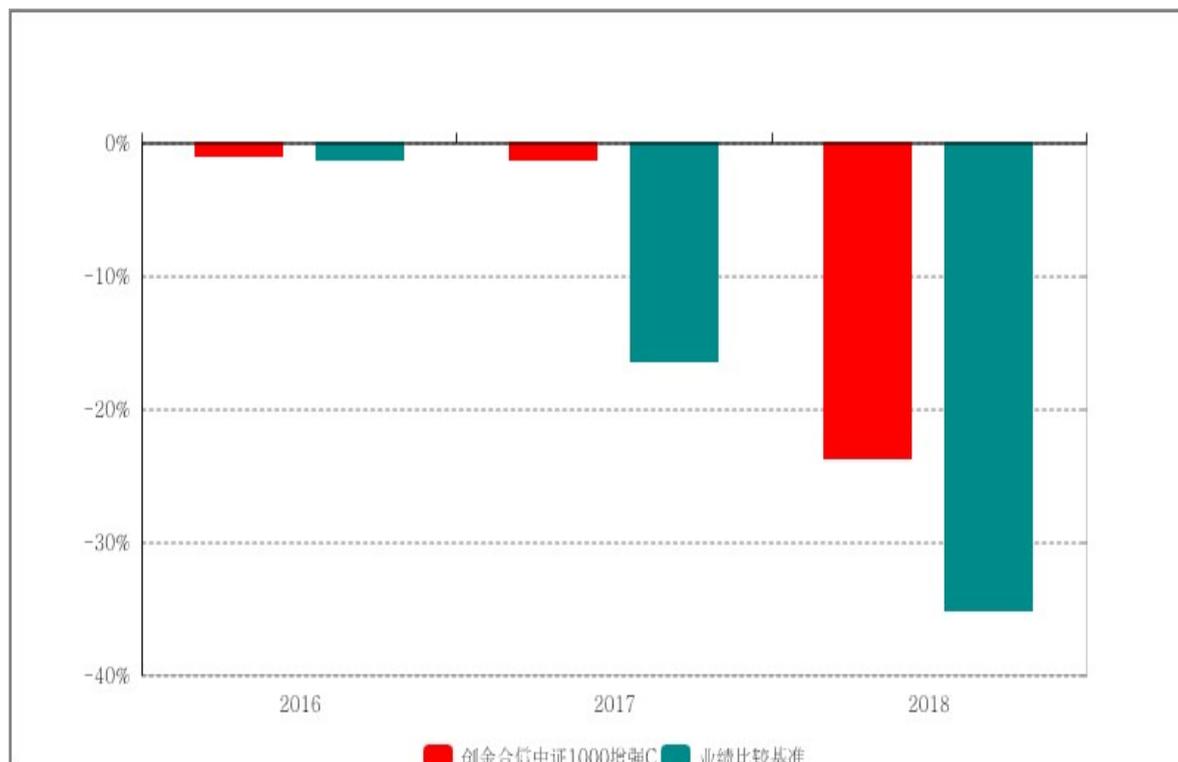
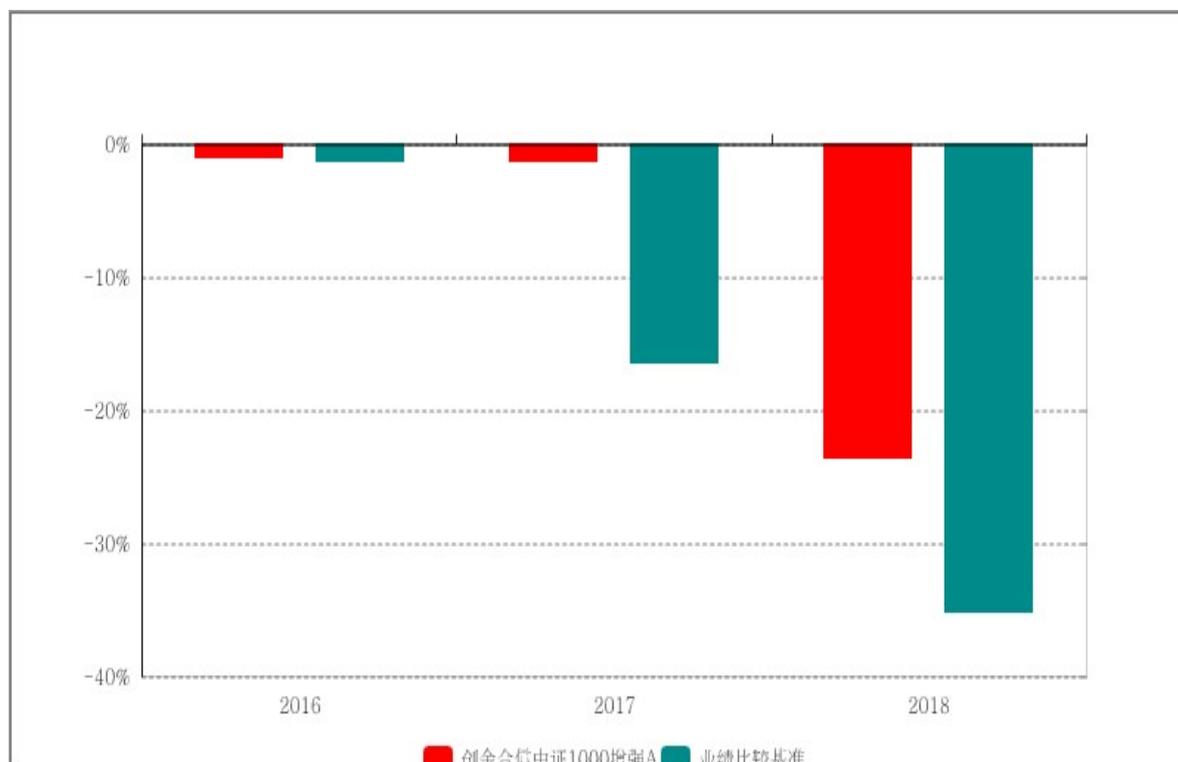
## 创金合信中证1000增强C

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



### 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。修订完善《信息披露制度》等制度，建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第24774号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简

	<p>称“创金合信中证1000增强基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了创金合信中证1000增强基金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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信中证1000增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	
其他事项	
其他信息	
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>创金合信中证1000增强基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创金合信中证1000增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理</p>

	<p>层计划清算创金合信中证1000增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督创金合信中证1000增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对创金合信中证1000增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审</p>

	计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致创金合信中证1000增强基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹翠丽、边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2019-03-26

## §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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,993,099.38
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		44,170,768.92	216,660,673.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	58,934,800.32	220,669,622.69
未分配利润	7.4.7.10	-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	附注号	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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-18,510,212.48	1,929,523.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	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	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	431,250.14	1,282,119.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-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）	7.4.7.17	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	7.4.10.2.1	630,834.22	1,623,015.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	118,281.34	304,315.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	48,739.29	13,562.33
4. 交易费用	7.4.7.18	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	7.4.7.19	205,803.08	181,657.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-23,254,528.06</b>	<b>-6,393,638.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-23,254,528.06</b>	<b>-6,393,638.41</b>

### 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)	220,669,622.69	-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)	-	-23,254,528.06	-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	-10,059,264.86	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	-15,087,729.71	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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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变动计入当期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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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认

列。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。

#### 7.4.4.8 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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	801,785.36	3,656,874.22
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	801,785.36	3,656,874.22

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,013,085.28	40,222,935.23	-1,790,150.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,228,832.00	2,228,580.80
	银行间市场	-	-
	合计	2,228,832.00	2,228,580.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他		-	-	-
合计		44,241,917.28	42,451,516.03	-1,790,401.25
项目	上年度末2017年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		197,395,992.93	196,110,171.06	-1,285,821.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	11,120,100.00	11,097,860.80	-22,239.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,120,100.00	11,097,860.80	-22,239.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		208,516,092.93	207,208,031.86	-1,308,061.07

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	179.49	1,997.46
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	344.85	1,490.50
应收债券利息	61,245.20	62,107.83
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	16.39	54.45
合计	61,785.93	65,650.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	88,543.41	1,014,705.99
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	88,543.41	1,014,705.99

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.62
预提费用	170,000.00	145,000.00
合计	170,000.00	145,000.62

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 创金合信中证1000增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	210,415,694.76	210,415,694.76
本期申购	27,549,402.41	27,549,402.41
本期赎回(以“-”号填列)	-210,945,245.50	-210,945,245.50
本期末	27,019,851.67	27,019,851.67

#### 7.4.7.9.2 创金合信中证1000增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,253,927.93	10,253,927.93
本期申购	71,462,369.58	71,462,369.58
本期赎回(以“-”号填列)	-49,801,348.86	-49,801,348.86
本期末	31,914,948.65	31,914,948.65

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 创金合信中证1000增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,662,246.40	552,093.37	-5,110,153.03
本期利润	-14,374,051.88	-446,384.98	-14,820,436.86
本期基金份额交易产生的变动数	11,679,902.07	1,347,005.18	13,026,907.25
其中：基金申购款	-5,373,282.49	1,409,228.01	-3,964,054.48
基金赎回款	17,053,184.56	-62,222.83	16,990,961.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,356,396.21	1,452,713.57	-6,903,682.64

## 7.4.7.10.2 创金合信中证1000增强C

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-279,083.96	26,910.99	-252,172.97
本期利润	-8,398,136.00	-35,955.20	-8,434,091.20
本期基金份额交易产生的变动数	-1,222,705.52	1,724,922.62	502,217.10
其中：基金申购款	-10,517,945.99	4,422,735.61	-6,095,210.38
基金赎回款	9,295,240.47	-2,697,812.99	6,597,427.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,899,925.48	1,715,878.41	-8,184,047.07

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
活期存款利息收入	13,874.01	78,276.59
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	32,143.51	41,655.28
其他	1,676.10	1,338.54
合计	47,693.62	121,270.41

## 7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	2,079,764,895.29	3,437,366,302.03
减：卖出股票成本总额	2,098,275,107.77	3,435,436,778.56

买卖股票差价收入	-18,510,212.48	1,929,523.47
----------	----------------	--------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付 ) 差价收入	21,106.66	13,125.03
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	21,106.66	13,125.03

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券(、债转 股及债券到期兑付 ) 成交总额	14,231,578.87	487,810.50
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	13,963,322.70	472,500.00
减：应收利息总额	247,149.51	2,185.47
买卖债券差价收入	21,106.66	13,125.03

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
股票投资产生的股利收益	431,250.14	1,282,119.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	431,250.14	1,282,119.98

## 7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日
1. 交易性金融资产	-482,340.18	-1,198,077.65
——股票投资	-504,328.18	-1,175,838.45
——债券投资	21,988.00	-22,239.20
——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	-482,340.18	-1,198,077.65

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
基金赎回费收入	101,772.28	21,076.14
转换费收入	2,340.28	2.67
合计	104,112.56	21,078.81

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	3,977,743.62	6,450,010.74
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,977,743.62	6,450,010.74

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
审计费用	60,000.00	35,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
汇划手续费	5,803.08	6,107.82
指数使用费	40,000.00	40,000.00
账户维护费	-	550.00
合计	205,803.08	181,657.82

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
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

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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	3,291,124,477.15	81.85%	4,202,818,751.90	59.58%

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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 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	13,400,879.65	83.27%	11,469,138.01	100.00%

## 7.4.10.1.4 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 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	78,500,000.00	75.85%	-	-

## 7.4.10.1.5 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	1,381,218.55	89.63%	-	-

证券股份 有限公司				
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	1,764,418.52	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至201 8年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 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。

## 7.4.10.2.2 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。

## 7.4.10.2.3 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年12月31日	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%

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年12月31日		2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份	801,785.36	13,874.01	3,656,874.22	78,276.59

有限公司				
------	--	--	--	--

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 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。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	-

##### 7.4.12.2 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	2018-12-25	重大事项停牌	8.77	2019-01-03	9.65	800	6,944.00	7,016.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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金融工具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。

#### 7.4.13.2 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和债券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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	0.00
A-1以下	-	0.00
未评级	-	10,575,620.00
合计	-	10,575,620.00

#### 7.4.13.2 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12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	490,240.80
AAA以下	28,944.80	32,000.00
未评级	2,199,636.00	0.00
合计	2,228,580.80	522,240.80

#### 7.4.13.3 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。

于2018年12月31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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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。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%。于2018年12月31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0.03%。

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12月31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43,428,097.80元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018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	801,785.36	-	-	-	801,785.36
结算备付金	696,932.85	-	-	-	696,932.85
存出保证金	33,180.97	-	-	-	33,180.97
交易性金融资产	2,199,636.00	-	28,944.80	40,222,935.23	42,451,516.03
应收利息	-	-	-	61,785.93	61,785.93
应收申购款	-	-	-	125,567.78	125,567.78
资产总计	3,731,535.18	-	28,944.80	40,410,288.94	44,170,768.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,546.94	25,546.94
应付管理人报酬	-	-	-	29,990.46	29,990.46

应付托管费	-	-	-	5,623.23	5,623.23
应付销售服务费	-	-	-	3,993.92	3,993.92
应付交易费用	-	-	-	88,543.41	88,543.41
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	323,698.31	323,698.31
利率敏感度缺口	3,731,535.18	-	28,944.80	40,086,590.63	43,847,070.61
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	3,656,874.22	-	-	-	3,656,874.22
结算备付金	3,011,126.34	-	-	-	3,011,126.34
存出保证金	110,107.64	-	-	-	110,107.64
交易性金融资产	10,575,620.00	490,240.80	32,000.00	196,110,171.06	207,208,031.86
应收证券清算款	-	-	-	1,993,099.38	1,993,099.38
应收利息	-	-	-	65,650.24	65,650.24
应收申购款	-	-	-	615,783.90	615,783.90
资产总计	17,353,728.20	490,240.80	32,000.00	198,784,704.58	216,660,673.58

负债					
应付赎回款	-	-	-	20,455.61	20,455.61
应付管理人报酬	-	-	-	144,506.50	144,506.50
应付托管费	-	-	-	27,094.96	27,094.96
应付销售服务费	-	-	-	1,613.21	1,613.21
应付交易费用	-	-	-	1,014,705.99	1,014,705.99
其他负债	-	-	-	145,000.62	145,000.62
负债总计	-	-	-	1,353,376.89	1,353,376.89
利率敏感度缺口	17,353,728.20	490,240.80	32,000.00	197,431,327.69	215,307,296.69

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.08%(2017年12月31日：5.16%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31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	40,222,935.23	91.73	196,110,171.06	91.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	40,222,935.23	91.73	196,110,171.06	91.08

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净	2,016,052.84	8,892,532.64

	值变动		
	比较基准下降5%资产净值变动	-2,016,052.84	-8,892,532.64

#### 7.4.14 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所有股票投资明细

#### 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	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

11	600323	瀚蓝环境	9,200	129,076.00	0.29
12	300038	数知科技	13,700	127,821.00	0.29
13	600320	振华重工	39,740	125,975.80	0.29
14	000591	太阳能	42,400	125,504.00	0.29
15	600803	新奥股份	12,400	123,256.00	0.28
16	600797	浙大网新	17,000	122,570.00	0.28
17	600728	佳都科技	17,500	120,575.00	0.27
18	002126	银轮股份	16,200	120,528.00	0.27
19	300271	华宇软件	8,000	120,080.00	0.27
20	000902	新洋丰	13,300	119,168.00	0.27
21	002396	星网锐捷	6,900	118,818.00	0.27
22	600490	鹏欣资源	26,000	118,300.00	0.27
23	002697	红旗连锁	22,900	117,477.00	0.27
24	002610	爱康科技	74,500	116,965.00	0.27
25	002151	北斗星通	5,500	116,050.00	0.26
26	002025	航天电器	5,400	115,722.00	0.26
27	603517	绝味食品	3,400	112,574.00	0.26
28	002419	天虹股份	10,200	111,894.00	0.26
29	300601	康泰生物	3,100	110,918.00	0.25
30	600845	宝信软件	5,300	110,505.00	0.25
31	000059	华锦股份	18,600	110,484.00	0.25
32	002449	国星光电	10,600	110,028.00	0.25
33	600486	扬农化工	2,900	109,214.00	0.25
34	002042	华孚时尚	20,100	109,143.00	0.25
35	600337	美克家居	27,100	107,045.00	0.24
36	300284	苏交科	10,300	106,811.00	0.24
37	000793	华闻传媒	35,600	105,732.00	0.24
38	601058	赛轮轮胎	47,400	105,702.00	0.24
39	600562	国睿科技	8,100	104,247.00	0.24
40	000683	远兴能源	43,600	103,332.00	0.24
41	300207	欣旺达	12,000	103,080.00	0.24

42	300036	超图软件	5,600	102,648.00	0.23
43	600269	赣粤高速	26,300	102,570.00	0.23
44	300294	博雅生物	3,800	102,562.00	0.23
45	000650	仁和药业	18,700	102,476.00	0.23
46	002614	奥佳华	6,400	102,080.00	0.23
47	000836	富通鑫茂	26,100	101,529.00	0.23
48	002262	恩华药业	11,200	101,024.00	0.23
49	002099	海翔药业	22,300	100,796.00	0.23
50	002020	京新药业	11,700	100,620.00	0.23
51	600123	兰花科创	15,400	100,408.00	0.23
52	000036	华联控股	18,200	100,282.00	0.23
53	000560	我爱我家	21,400	99,938.00	0.23
54	601588	北辰实业	36,600	99,186.00	0.23
55	600330	天通股份	17,900	98,629.00	0.22
56	000875	吉电股份	40,200	98,490.00	0.22
57	002073	软控股份	21,600	97,848.00	0.22
58	002402	和而泰	15,800	97,644.00	0.22
59	603368	柳药股份	3,700	96,940.00	0.22
60	600711	盛屯矿业	21,200	96,884.00	0.22
61	600577	精达股份	32,500	96,525.00	0.22
62	600033	福建高速	32,300	95,931.00	0.22
63	002145	中核钛白	29,700	95,634.00	0.22
64	600491	龙元建设	14,100	95,457.00	0.22
65	600851	海欣股份	13,700	95,078.00	0.22
66	300185	通裕重工	58,600	94,346.00	0.22
67	000789	万年青	8,600	93,654.00	0.21
68	600420	现代制药	10,200	93,228.00	0.21
69	600708	光明地产	26,700	93,183.00	0.21
70	600067	冠城大通	25,000	93,000.00	0.21
71	600681	百川能源	7,800	92,352.00	0.21
72	000901	航天科技	10,400	91,936.00	0.21

73	002022	科华生物	9,800	91,924.00	0.21
74	000676	智度股份	9,600	91,104.00	0.21
75	300226	上海钢联	2,000	91,060.00	0.21
76	300098	高新兴	13,400	90,584.00	0.21
77	000697	炼石航空	7,300	90,447.00	0.21
78	603708	家家悦	4,500	90,405.00	0.21
79	000546	金圆股份	10,400	90,064.00	0.21
80	002717	岭南股份	10,100	89,991.00	0.21
81	000016	深康佳 A	27,700	89,748.00	0.20
82	600502	安徽水利	25,200	89,712.00	0.20
83	002303	美盈森	19,200	89,280.00	0.20
84	002585	双星新材	17,500	89,250.00	0.20
85	300523	辰安科技	1,500	89,250.00	0.20
86	600308	华泰股份	20,400	88,740.00	0.20
87	600285	羚锐制药	11,800	88,736.00	0.20
88	002643	万润股份	8,700	88,044.00	0.20
89	000555	神州信息	9,400	87,796.00	0.20
90	300339	润和软件	9,600	87,552.00	0.20
91	000666	经纬纺机	8,100	87,318.00	0.20
92	002429	兆驰股份	45,800	87,020.00	0.20
93	603660	苏州科达	5,200	86,684.00	0.20
94	300047	天源迪科	7,800	86,658.00	0.20
95	002550	千红制药	22,800	86,640.00	0.20
96	000910	大亚圣象	8,400	86,604.00	0.20
97	300369	绿盟科技	10,000	86,600.00	0.20
98	600966	博汇纸业	27,500	86,350.00	0.20
99	002484	江海股份	14,000	86,240.00	0.20
100	000672	上峰水泥	10,200	86,088.00	0.20
101	002031	巨轮智能	45,700	85,916.00	0.20
102	300476	胜宏科技	7,320	85,644.00	0.20
103	002327	富安娜	11,400	85,614.00	0.20

104	600422	昆药集团	13,800	85,284.00	0.19
105	002036	联创电子	9,900	85,140.00	0.19
106	002222	福晶科技	8,700	84,912.00	0.19
107	002343	慈文传媒	9,400	84,788.00	0.19
108	002206	海利得	22,200	84,582.00	0.19
109	601908	京运通	26,800	84,420.00	0.19
110	000751	锌业股份	29,500	84,075.00	0.19
111	601700	风范股份	22,000	84,040.00	0.19
112	600227	圣济堂	30,400	83,904.00	0.19
113	600059	古越龙山	12,700	83,820.00	0.19
114	600771	广誉远	2,900	83,723.00	0.19
115	600715	文投控股	18,600	83,700.00	0.19
116	600255	梦舟股份	46,500	83,700.00	0.19
117	002003	伟星股份	11,900	83,538.00	0.19
118	600063	皖维高新	35,800	83,414.00	0.19
119	002139	拓邦股份	21,200	83,104.00	0.19
120	002387	维信诺	10,900	83,058.00	0.19
121	600239	云南城投	28,800	82,944.00	0.19
122	000828	东莞控股	11,100	82,917.00	0.19
123	300219	鸿利智汇	10,800	82,728.00	0.19
124	601677	明泰铝业	9,400	82,626.00	0.19
125	603588	高能环境	10,500	82,425.00	0.19
126	002467	二六三	16,200	81,972.00	0.19
127	300323	华灿光电	11,300	81,699.00	0.19
128	300039	上海凯宝	20,100	81,606.00	0.19
129	002821	凯莱英	1,200	81,420.00	0.19
130	300232	洲明科技	8,500	81,090.00	0.18
131	300118	东方日升	14,200	80,798.00	0.18
132	603989	艾华集团	4,000	80,560.00	0.18
133	002626	金达威	6,700	80,534.00	0.18
134	000831	五矿稀土	9,600	80,352.00	0.18

135	002171	楚江新材	17,300	80,099.00	0.18
136	300045	华力创通	10,500	79,590.00	0.18
137	601101	昊华能源	13,200	79,332.00	0.18
138	600322	天房发展	24,400	79,300.00	0.18
139	002309	中利集团	9,500	79,230.00	0.18
140	300170	汉得信息	8,100	79,218.00	0.18
141	600363	联创光电	9,900	79,200.00	0.18
142	002649	博彦科技	10,800	79,164.00	0.18
143	002698	博实股份	8,900	79,121.00	0.18
144	600300	维维股份	28,000	78,960.00	0.18
145	000733	振华科技	7,200	78,768.00	0.18
146	002095	生意宝	4,000	78,720.00	0.18
147	600590	泰豪科技	14,600	78,694.00	0.18
148	002341	新纶科技	6,599	78,396.12	0.18
149	600114	东睦股份	12,500	78,375.00	0.18
150	600508	上海能源	8,100	78,165.00	0.18
151	300183	东软载波	6,600	77,682.00	0.18
152	300628	亿联网络	1,000	77,660.00	0.18
153	002501	利源精制	27,400	77,542.00	0.18
154	000735	罗牛山	8,000	77,280.00	0.18
155	300237	美晨生态	21,200	76,956.00	0.18
156	601163	三角轮胎	6,900	76,866.00	0.18
157	600211	西藏药业	2,600	76,726.00	0.17
158	002283	天润曲轴	22,900	76,715.00	0.17
159	600602	云赛智联	15,400	76,692.00	0.17
160	002531	天顺风能	17,200	76,540.00	0.17
161	000889	中嘉博创	7,500	76,500.00	0.17
162	000030	富奥股份	20,600	76,426.00	0.17
163	002055	得润电子	7,900	76,393.00	0.17
164	600075	新疆天业	16,900	76,388.00	0.17
165	600676	交运股份	17,700	76,287.00	0.17

166	002611	东方精工	20,300	76,125.00	0.17
167	601799	星宇股份	1,600	76,000.00	0.17
168	300438	鹏辉能源	4,700	75,952.00	0.17
169	300130	新国都	6,700	75,844.00	0.17
170	002240	威华股份	10,400	75,816.00	0.17
171	300336	新文化	17,200	75,680.00	0.17
172	603636	南威软件	7,800	74,880.00	0.17
173	601126	四方股份	14,700	74,823.00	0.17
174	000043	中航善达	10,000	74,800.00	0.17
175	002867	周大生	2,700	74,601.00	0.17
176	300388	国祯环保	8,400	74,340.00	0.17
177	002433	太安堂	15,800	74,102.00	0.17
178	002568	百润股份	8,100	74,034.00	0.17
179	300012	华测检测	11,300	74,015.00	0.17
180	002224	三力士	13,700	73,980.00	0.17
181	002279	久其软件	10,400	73,944.00	0.17
182	600326	西藏天路	11,400	73,872.00	0.17
183	601929	吉视传媒	36,000	73,800.00	0.17
184	601949	中国出版	16,800	73,752.00	0.17
185	600057	厦门象屿	17,600	73,568.00	0.17
186	000601	韶能股份	19,700	73,284.00	0.17
187	000301	东方盛虹	13,400	73,164.00	0.17
188	603118	共进股份	11,600	73,080.00	0.17
189	000973	佛塑科技	22,700	72,867.00	0.17
190	601666	平煤股份	20,600	72,512.00	0.17
191	600054	黄山旅游	7,700	72,226.00	0.16
192	603980	吉华集团	6,100	71,797.00	0.16
193	600012	皖通高速	11,900	71,757.00	0.16
194	002540	亚太科技	15,500	71,610.00	0.16
195	002060	粤水电	26,200	71,264.00	0.16
196	603108	润达医疗	9,900	71,181.00	0.16

197	002413	雷科防务	13,300	71,155.00	0.16
198	002182	云海金属	11,400	71,136.00	0.16
199	300233	金城医药	5,200	70,980.00	0.16
200	600103	青山纸业	27,700	70,912.00	0.16
201	603939	益丰药房	1,700	70,890.00	0.16
202	000055	方大集团	17,700	70,800.00	0.16
203	600995	文山电力	10,700	70,727.00	0.16
204	000065	北方国际	9,200	70,656.00	0.16
205	300007	汉威科技	7,200	70,632.00	0.16
206	000545	金浦钛业	22,500	70,425.00	0.16
207	000968	蓝焰控股	6,600	70,290.00	0.16
208	603393	新天然气	2,300	70,150.00	0.16
209	600129	太极集团	8,400	70,140.00	0.16
210	603808	歌力思	4,300	69,832.00	0.16
211	603298	杭叉集团	5,900	69,738.00	0.16
212	002539	云图控股	17,000	69,700.00	0.16
213	000592	平潭发展	26,100	69,687.00	0.16
214	000965	天保基建	18,100	69,685.00	0.16
215	603979	金诚信	9,300	69,657.00	0.16
216	002648	卫星石化	7,200	69,624.00	0.16
217	600449	宁夏建材	9,400	69,278.00	0.16
218	300203	聚光科技	2,700	69,255.00	0.16
219	300303	聚飞光电	28,400	69,012.00	0.16
220	000070	特发信息	9,700	68,870.00	0.16
221	600480	凌云股份	9,000	68,670.00	0.16
222	600467	好当家	28,600	68,640.00	0.16
223	002481	双塔食品	24,500	68,600.00	0.16
224	600668	尖峰集团	5,800	68,440.00	0.16
225	600596	新安股份	6,400	68,416.00	0.16
226	600720	祁连山	10,600	68,370.00	0.16
227	603367	辰欣药业	4,500	68,310.00	0.16

228	600035	楚天高速	23,100	68,145.00	0.16
229	300009	安科生物	5,100	68,136.00	0.16
230	600559	老白干酒	5,500	67,980.00	0.16
231	002756	永兴特钢	5,700	67,944.00	0.15
232	600382	广东明珠	8,800	67,936.00	0.15
233	603920	世运电路	5,700	67,887.00	0.15
234	002068	黑猫股份	11,500	67,850.00	0.15
235	600686	金龙汽车	9,900	67,815.00	0.15
236	300366	创意信息	9,200	67,344.00	0.15
237	603003	龙宇燃油	10,000	67,300.00	0.15
238	002247	聚力文化	14,400	67,104.00	0.15
239	601599	鹿港文化	21,500	67,080.00	0.15
240	300184	力源信息	8,800	66,968.00	0.15
241	000544	中原环保	13,200	66,924.00	0.15
242	300205	天喻信息	8,200	66,748.00	0.15
243	002393	力生制药	3,100	66,743.00	0.15
244	603609	禾丰牧业	8,600	66,650.00	0.15
245	601369	陕鼓动力	11,000	66,550.00	0.15
246	300083	劲胜智能	28,100	66,316.00	0.15
247	002168	惠程科技	6,700	66,263.00	0.15
248	603345	安井食品	1,800	66,240.00	0.15
249	603599	广信股份	6,300	66,150.00	0.15
250	603898	好莱客	4,300	65,919.00	0.15
251	300255	常山药业	16,100	65,849.00	0.15
252	000040	东旭蓝天	9,100	65,793.00	0.15
253	002727	一心堂	3,700	65,786.00	0.15
254	002033	丽江旅游	11,600	65,772.00	0.15
255	300485	赛升药业	6,700	65,727.00	0.15
256	000404	长虹华意	17,000	65,620.00	0.15
257	600533	栖霞建设	22,300	65,562.00	0.15
258	002079	苏州固锝	14,000	65,380.00	0.15

259	002705	新宝股份	7,100	65,178.00	0.15
260	300363	博腾股份	7,300	64,678.00	0.15
261	603008	喜临门	7,000	64,540.00	0.15
262	300145	中金环境	19,800	64,350.00	0.15
263	600650	锦江投资	6,800	64,260.00	0.15
264	600985	淮北矿业	6,900	64,170.00	0.15
265	300377	赢时胜	5,800	64,032.00	0.15
266	601900	南方传媒	7,600	63,992.00	0.15
267	300304	云意电气	18,700	63,954.00	0.15
268	000516	国际医学	12,900	63,855.00	0.15
269	002609	捷顺科技	11,500	63,710.00	0.15
270	600162	香江控股	29,200	63,656.00	0.15
271	002322	理工环科	7,000	63,560.00	0.14
272	002318	久立特材	10,000	63,400.00	0.14
273	600616	金枫酒业	13,300	63,308.00	0.14
274	300191	潜能恒信	4,300	63,296.00	0.14
275	600997	开滦股份	11,100	62,937.00	0.14
276	600273	嘉化能源	7,000	62,930.00	0.14
277	002772	众兴菌业	9,700	62,759.00	0.14
278	300212	易华录	3,000	62,160.00	0.14
279	300465	高伟达	10,300	61,903.00	0.14
280	300276	三丰智能	6,000	61,860.00	0.14
281	002430	杭氧股份	6,600	61,710.00	0.14
282	300307	慈星股份	12,900	61,662.00	0.14
283	300172	中电环保	11,800	61,596.00	0.14
284	000958	东方能源	19,100	61,502.00	0.14
285	002329	皇氏集团	18,900	61,425.00	0.14
286	600501	航天晨光	10,100	61,307.00	0.14
287	300309	吉艾科技	7,600	61,256.00	0.14
288	002097	山河智能	11,000	61,050.00	0.14
289	600512	腾达建设	28,200	60,630.00	0.14

290	000710	贝瑞基因	1,900	60,610.00	0.14
291	300194	福安药业	18,800	60,348.00	0.14
292	002872	天圣制药	7,000	59,920.00	0.14
293	603803	瑞斯康达	5,900	59,767.00	0.14
294	002232	启明信息	8,800	59,752.00	0.14
295	000700	模塑科技	20,200	59,590.00	0.14
296	002246	北化股份	9,000	59,490.00	0.14
297	002401	中远海科	6,600	59,202.00	0.14
298	002712	思美传媒	9,900	59,103.00	0.13
299	002685	华东重机	12,000	59,040.00	0.13
300	000885	城发环境	8,200	58,794.00	0.13
301	601595	上海电影	4,800	58,704.00	0.13
302	600132	重庆啤酒	1,900	58,387.00	0.13
303	300073	当升科技	2,100	58,149.00	0.13
304	002605	姚记扑克	7,700	57,827.00	0.13
305	300378	鼎捷软件	5,900	57,761.00	0.13
306	002104	恒宝股份	9,800	57,428.00	0.13
307	300528	幸福蓝海	6,800	57,120.00	0.13
308	300533	冰川网络	1,800	56,862.00	0.13
309	002788	鹭燕医药	4,500	56,790.00	0.13
310	300468	四方精创	4,700	56,635.00	0.13
311	002135	东南网架	11,400	56,544.00	0.13
312	002675	东诚药业	7,100	55,877.00	0.13
313	603612	索通发展	4,800	55,872.00	0.13
314	002521	齐峰新材	10,000	55,700.00	0.13
315	603385	惠达卫浴	6,900	55,269.00	0.13
316	603801	志邦家居	2,300	55,223.00	0.13
317	300511	雪榕生物	9,200	54,924.00	0.13
318	300061	康旗股份	9,200	54,740.00	0.12
319	002530	金财互联	8,300	54,697.00	0.12
320	000797	中国武夷	12,000	54,600.00	0.12

321	002071	长城影视	12,000	54,600.00	0.12
322	002812	恩捷股份	1,100	54,351.00	0.12
323	600261	阳光照明	15,800	53,878.00	0.12
324	603113	金能科技	4,900	53,753.00	0.12
325	000731	四川美丰	10,700	53,714.00	0.12
326	002185	华天科技	13,000	52,780.00	0.12
327	300467	迅游科技	2,300	52,739.00	0.12
328	600798	宁波海运	16,300	52,649.00	0.12
329	603358	华达科技	4,860	52,245.00	0.12
330	300160	秀强股份	15,100	52,095.00	0.12
331	002245	澳洋顺昌	13,100	50,828.00	0.12
332	300014	亿纬锂能	3,200	50,304.00	0.11
333	603277	银都股份	5,600	49,056.00	0.11
334	300065	海兰信	4,700	48,034.00	0.11
335	000631	顺发恒业	16,000	47,520.00	0.11
336	000701	厦门信达	7,800	47,268.00	0.11
337	000818	航锦科技	5,100	47,073.00	0.11
338	600571	信雅达	7,400	46,620.00	0.11
339	600231	凌钢股份	17,300	46,191.00	0.11
340	002737	葵花药业	3,100	45,818.00	0.10
341	603678	火炬电子	2,900	45,733.00	0.10
342	000881	中广核技	6,800	45,696.00	0.10
343	600702	舍得酒业	2,000	45,640.00	0.10
344	600096	云天化	9,100	45,591.00	0.10
345	300066	三川智慧	13,700	45,484.00	0.10
346	002538	司尔特	9,400	45,402.00	0.10
347	002335	科华恒盛	3,000	45,210.00	0.10
348	002746	仙坛股份	3,300	45,144.00	0.10
349	002035	华帝股份	5,100	45,135.00	0.10
350	002537	海联金汇	4,400	45,100.00	0.10
351	603338	浙江鼎力	800	45,056.00	0.10

352	600661	昂立教育	2,300	44,988.00	0.10
353	300558	贝达药业	1,400	44,758.00	0.10
354	300180	华峰超纤	4,000	44,600.00	0.10
355	000815	美利云	6,600	44,550.00	0.10
356	601011	宝泰隆	8,100	44,550.00	0.10
357	603686	龙马环卫	4,100	44,526.00	0.10
358	600641	万业企业	4,900	44,492.00	0.10
359	300048	合康新能	18,600	44,454.00	0.10
360	000837	秦川机床	11,200	44,016.00	0.10
361	300054	鼎龙股份	6,900	43,953.00	0.10
362	603618	杭电股份	8,400	43,848.00	0.10
363	000957	中通客车	9,800	43,610.00	0.10
364	300531	优博讯	2,600	43,602.00	0.10
365	300213	佳讯飞鸿	7,800	43,602.00	0.10
366	002178	延华智能	11,800	43,306.00	0.10
367	002382	蓝帆医疗	2,900	43,094.00	0.10
368	300188	美亚柏科	3,300	42,966.00	0.10
369	002157	正邦科技	8,000	42,480.00	0.10
370	300463	迈克生物	2,900	42,340.00	0.10
371	002130	沃尔核材	13,000	42,120.00	0.10
372	603313	梦百合	2,000	42,020.00	0.10
373	600742	一汽富维	4,200	41,916.00	0.10
374	300349	金卡智能	2,600	41,860.00	0.10
375	601636	旗滨集团	11,000	41,800.00	0.10
376	300053	欧比特	5,100	41,616.00	0.09
377	300439	美康生物	3,100	41,416.00	0.09
378	002023	海特高新	4,000	41,400.00	0.09
379	300114	中航电测	5,800	41,296.00	0.09
380	300068	南都电源	2,900	41,238.00	0.09
381	002061	浙江交科	4,000	41,080.00	0.09
382	000603	盛达矿业	4,100	41,000.00	0.09

383	002590	万安科技	6,300	40,068.00	0.09
384	000971	高升控股	12,000	39,840.00	0.09
385	600986	科达股份	9,500	39,805.00	0.09
386	600622	光大嘉宝	7,000	39,690.00	0.09
387	002436	兴森科技	8,700	39,324.00	0.09
388	000795	英洛华	11,000	39,270.00	0.09
389	600477	杭萧钢构	10,900	39,240.00	0.09
390	002234	民和股份	3,400	38,930.00	0.09
391	600626	申达股份	7,800	38,532.00	0.09
392	603218	日月股份	2,300	37,996.00	0.09
393	002215	诺普信	5,400	36,504.00	0.08
394	300512	中亚股份	3,000	36,000.00	0.08
395	600764	中国海防	1,500	35,760.00	0.08
396	600846	同济科技	5,000	35,750.00	0.08
397	002906	华阳集团	3,600	35,136.00	0.08
398	300078	思创医惠	3,500	34,790.00	0.08
399	000918	嘉凯城	4,500	34,290.00	0.08
400	603839	安正时尚	3,200	34,240.00	0.08
401	002511	中顺洁柔	4,000	34,080.00	0.08
402	000800	一汽轿车	5,100	33,762.00	0.08
403	300037	新宙邦	1,400	33,670.00	0.08
404	600756	浪潮软件	2,200	33,638.00	0.08
405	002047	宝鹰股份	4,900	33,565.00	0.08
406	300496	中科创达	1,500	33,150.00	0.08
407	603817	海峡环保	5,500	33,055.00	0.08
408	603339	四方科技	2,200	32,890.00	0.08
409	600093	易见股份	4,300	32,594.00	0.07
410	300451	创业慧康	1,700	32,555.00	0.07
411	300222	科大智能	2,100	32,550.00	0.07
412	000851	高鸿股份	6,800	32,368.00	0.07
413	600529	山东药玻	1,700	32,300.00	0.07

414	002618	丹邦科技	2,300	31,671.00	0.07
415	600612	老凤祥	700	31,500.00	0.07
416	300326	凯利泰	3,700	31,450.00	0.07
417	300365	恒华科技	1,500	31,350.00	0.07
418	600020	中原高速	8,510	31,231.70	0.07
419	600868	梅雁吉祥	10,900	31,065.00	0.07
420	002421	达实智能	7,800	30,576.00	0.07
421	002597	金禾实业	1,900	30,191.00	0.07
422	600456	宝钛股份	2,000	30,180.00	0.07
423	000921	海信家电	4,200	29,694.00	0.07
424	300357	我武生物	800	29,592.00	0.07
425	601222	林洋能源	6,100	29,524.00	0.07
426	600604	市北高新	3,800	29,298.00	0.07
427	300529	健帆生物	700	29,050.00	0.07
428	300097	智云股份	2,600	29,042.00	0.07
429	300177	中海达	2,800	28,644.00	0.07
430	300355	蒙草生态	7,300	28,397.00	0.06
431	000951	中国重汽	2,545	28,351.30	0.06
432	300457	赢合科技	1,000	27,850.00	0.06
433	300149	量子生物	1,900	27,797.00	0.06
434	600360	华微电子	5,400	27,756.00	0.06
435	600446	金证股份	2,900	27,550.00	0.06
436	000739	普洛药业	3,700	27,528.00	0.06
437	600279	重庆港九	6,900	26,979.00	0.06
438	002298	中电兴发	4,500	26,550.00	0.06
439	002462	嘉事堂	1,800	26,010.00	0.06
440	600531	豫光金铅	7,400	25,826.00	0.06
441	600569	安阳钢铁	8,500	25,755.00	0.06
442	002261	拓维信息	6,100	25,742.00	0.06
443	603299	苏盐井神	5,000	25,650.00	0.06
444	600185	格力地产	6,300	25,515.00	0.06

445	601388	怡球资源	13,100	25,283.00	0.06
446	002089	新海宜	5,800	24,940.00	0.06
447	600568	中珠医疗	10,800	24,624.00	0.06
448	002630	华西能源	8,600	24,510.00	0.06
449	002389	航天彩虹	2,000	24,420.00	0.06
450	300616	尚品宅配	400	24,308.00	0.06
451	002314	南山控股	8,400	24,108.00	0.05
452	002239	奥特佳	12,000	24,000.00	0.05
453	002488	金固股份	3,600	23,868.00	0.05
454	002833	弘亚数控	700	23,800.00	0.05
455	300016	北陆药业	3,400	23,800.00	0.05
456	002253	川大智胜	1,800	23,796.00	0.05
457	600707	彩虹股份	5,700	23,541.00	0.05
458	300157	恒泰艾普	5,600	23,240.00	0.05
459	600740	山西焦化	2,900	23,229.00	0.05
460	002554	惠博普	8,500	23,035.00	0.05
461	300079	数码科技	7,000	23,030.00	0.05
462	600305	恒顺醋业	2,200	22,880.00	0.05
463	300123	亚光科技	2,500	22,825.00	0.05
464	600110	诺德股份	5,600	22,736.00	0.05
465	002313	日海智能	1,000	22,580.00	0.05
466	002497	雅化集团	3,400	22,576.00	0.05
467	002582	好想你	3,000	22,560.00	0.05
468	300158	振东制药	5,900	22,479.00	0.05
469	603308	应流股份	2,800	22,456.00	0.05
470	002516	旷达科技	7,900	22,436.00	0.05
471	601918	新集能源	7,400	22,274.00	0.05
472	002409	雅克科技	1,600	22,192.00	0.05
473	300332	天壕环境	6,000	22,140.00	0.05
474	300311	任子行	3,800	22,078.00	0.05
475	300458	全志科技	1,100	22,000.00	0.05

476	600783	鲁信创投	1,400	21,952.00	0.05
477	002086	东方海洋	5,000	21,800.00	0.05
478	300215	电科院	4,100	21,730.00	0.05
479	601375	中原证券	5,100	21,726.00	0.05
480	000811	冰轮环境	4,200	21,714.00	0.05
481	002196	方正电机	4,200	21,294.00	0.05
482	300367	东方网力	2,400	21,288.00	0.05
483	300137	先河环保	2,600	21,190.00	0.05
484	603323	吴江银行	3,460	21,140.60	0.05
485	601789	宁波建工	6,800	21,080.00	0.05
486	300359	全通教育	3,600	21,060.00	0.05
487	002557	洽洽食品	1,100	20,944.00	0.05
488	300424	航新科技	1,500	20,910.00	0.05
489	002166	莱茵生物	3,400	20,876.00	0.05
490	600855	航天长峰	2,300	20,769.00	0.05
491	600226	瀚叶股份	7,400	20,720.00	0.05
492	300077	国民技术	2,800	20,692.00	0.05
493	000933	神火股份	5,300	20,670.00	0.05
494	002631	德尔未来	3,200	20,608.00	0.05
495	601137	博威合金	3,000	20,460.00	0.05
496	002203	海亮股份	2,600	20,436.00	0.05
497	300482	万孚生物	800	20,328.00	0.05
498	002237	恒邦股份	2,400	20,112.00	0.05
499	603508	思维列控	500	19,905.00	0.05
500	600116	三峡水利	2,700	19,764.00	0.05
501	600210	紫江企业	5,400	19,656.00	0.04
502	300328	宜安科技	3,200	19,648.00	0.04
503	001896	豫能控股	6,400	19,520.00	0.04
504	002534	杭锅股份	3,600	19,260.00	0.04
505	300660	江苏雷利	1,000	19,220.00	0.04
506	603900	莱绅通灵	1,600	19,056.00	0.04

507	000507	珠海港	2,800	18,480.00	0.04
508	600667	太极实业	3,600	18,396.00	0.04
509	002108	沧州明珠	4,200	17,682.00	0.04
510	000989	九芝堂	1,800	17,658.00	0.04
511	000429	粤高速 A	2,100	17,619.00	0.04
512	002091	江苏国泰	3,100	17,360.00	0.04
513	600200	江苏吴中	2,900	17,168.00	0.04
514	600173	卧龙地产	4,500	16,965.00	0.04
515	300102	乾照光电	2,900	16,907.00	0.04
516	601882	海天精工	2,400	16,896.00	0.04
517	300447	全信股份	1,800	16,704.00	0.04
518	002156	通富微电	2,300	16,399.00	0.04
519	600230	沧州大化	1,000	16,150.00	0.04
520	601015	陕西黑猫	3,000	15,930.00	0.04
521	000035	中国天楹	3,000	15,600.00	0.04
522	600108	亚盛集团	5,900	15,576.00	0.04
523	603718	海利生物	1,200	15,192.00	0.03
524	600988	赤峰黄金	3,800	15,162.00	0.03
525	300567	精测电子	300	15,144.00	0.03
526	300618	寒锐钴业	200	14,816.00	0.03
527	002716	金贵银业	2,400	14,712.00	0.03
528	300699	光威复材	400	14,320.00	0.03
529	600206	有研新材	2,100	13,713.00	0.03
530	603043	广州酒家	500	13,540.00	0.03
531	300495	美尚生态	1,000	13,200.00	0.03
532	002219	恒康医疗	3,800	13,072.00	0.03
533	002067	景兴纸业	3,700	12,987.00	0.03
534	002364	中恒电气	1,100	12,936.00	0.03
535	600789	鲁抗医药	1,700	12,835.00	0.03
536	002510	天汽模	3,500	12,565.00	0.03
537	000088	盐田港	2,500	12,500.00	0.03

538	600400	红豆股份	3,200	12,000.00	0.03
539	600856	中天能源	3,200	11,904.00	0.03
540	300101	振芯科技	1,200	11,880.00	0.03
541	002574	明牌珠宝	2,400	11,832.00	0.03
542	002502	骅威文化	2,900	11,426.00	0.03
543	600621	华鑫股份	1,300	11,414.00	0.03
544	002596	海南瑞泽	1,900	11,381.00	0.03
545	300516	久之洋	400	11,008.00	0.03
546	603303	得邦照明	900	10,665.00	0.02
547	601069	西部黄金	700	10,409.00	0.02
548	000869	张裕 A	400	10,400.00	0.02
549	002124	天邦股份	1,500	10,200.00	0.02
550	002258	利尔化学	700	9,198.00	0.02
551	000882	华联股份	4,100	9,143.00	0.02
552	000935	四川双马	600	9,024.00	0.02
553	600391	航发科技	800	8,744.00	0.02
554	002117	东港股份	600	8,490.00	0.02
555	300666	江丰电子	200	8,264.00	0.02
556	600495	晋西车轴	2,000	8,220.00	0.02
557	600076	康欣新材	2,000	8,200.00	0.02
558	600217	中再资环	2,000	8,180.00	0.02
559	002192	融捷股份	400	7,296.00	0.02
560	300292	吴通控股	1,900	7,258.00	0.02
561	002326	永太科技	1,000	6,990.00	0.02
562	600990	四创电子	200	6,858.00	0.02
563	002370	亚太药业	400	6,644.00	0.02
564	600197	伊力特	500	6,515.00	0.01
565	002256	兆新股份	2,200	6,490.00	0.01
566	600105	永鼎股份	1,600	6,176.00	0.01
567	002859	洁美科技	200	6,150.00	0.01
568	603357	设计总院	300	5,985.00	0.01

569	300379	东方通	400	5,620.00	0.01
570	002668	奥马电器	1,100	5,357.00	0.01
571	002425	凯撒文化	900	5,292.00	0.01
572	002547	春兴精工	1,000	5,290.00	0.01
573	300352	北信源	1,400	4,606.00	0.01
574	300178	腾邦国际	500	4,520.00	0.01
575	300568	星源材质	200	4,438.00	0.01
576	002267	陕天然气	600	4,434.00	0.01
577	600812	华北制药	1,100	4,400.00	0.01
578	300075	数字政通	400	4,360.00	0.01
579	000687	华讯方舟	600	4,260.00	0.01
580	603128	华贸物流	800	4,256.00	0.01
581	002080	中材科技	500	4,045.00	0.01
582	300595	欧普康视	100	3,874.00	0.01
583	600677	航天通信	400	3,788.00	0.01
584	603337	杰克股份	100	3,669.00	0.01
585	600172	黄河旋风	1,200	3,660.00	0.01
586	002284	亚太股份	800	3,400.00	0.01
587	300429	强力新材	100	3,120.00	0.01
588	000936	华西股份	500	3,060.00	0.01
589	000525	红太阳	200	2,806.00	0.01
590	300031	宝通科技	200	2,638.00	0.01
591	300409	道氏技术	200	2,622.00	0.01
592	002321	华英农业	500	2,580.00	0.01
593	000802	北京文化	200	2,214.00	0.01
594	002115	三维通信	200	1,974.00	0.00
595	603707	健友股份	100	1,877.00	0.00
596	002542	中化岩土	400	1,720.00	0.00
597	000996	中国中期	200	1,672.00	0.00
598	601139	深圳燃气	300	1,611.00	0.00
599	300085	银之杰	200	1,592.00	0.00

600	002564	天沃科技	300	1,506.00	0.00
601	002781	奇信股份	100	1,441.00	0.00
602	000976	华铁股份	300	1,374.00	0.00
603	600133	东湖高新	200	1,260.00	0.00
604	300252	金信诺	100	1,090.00	0.00
605	603399	吉翔股份	100	982.00	0.00
606	000582	北部湾港	100	704.00	0.00
607	002307	北新路桥	100	534.00	0.00

### 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	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
6	300196	长海股份	4,700	41,501.00	0.09
7	002339	积成电子	6,700	41,004.00	0.09
8	600606	绿地控股	6,700	40,937.00	0.09
9	601717	郑煤机	7,400	40,922.00	0.09
10	002150	通润装备	6,600	40,920.00	0.09
11	600292	远达环保	8,300	40,919.00	0.09
12	600894	广日股份	7,500	40,875.00	0.09
13	603020	爱普股份	5,500	40,865.00	0.09
14	600060	海信电器	4,700	40,796.00	0.09
15	600089	特变电工	6,000	40,740.00	0.09
16	002546	新联电子	10,800	40,716.00	0.09
17	002541	鸿路钢构	5,800	40,716.00	0.09
18	600611	大众交通	10,200	40,698.00	0.09

19	002048	宁波华翔	3,900	40,677.00	0.09
20	603611	诺力股份	3,300	40,524.00	0.09
21	601678	滨化股份	9,600	40,512.00	0.09
22	600713	南京医药	9,502	40,478.52	0.09
23	000900	现代投资	10,400	40,456.00	0.09
24	002589	瑞康医药	5,800	40,426.00	0.09
25	600051	宁波联合	7,500	40,425.00	0.09
26	000623	吉林敖东	2,800	40,404.00	0.09
27	600623	华谊集团	5,000	40,400.00	0.09
28	000926	福星股份	6,600	40,392.00	0.09
29	002140	东华科技	7,000	40,320.00	0.09
30	000157	中联重科	11,300	40,228.00	0.09
31	002160	常铝股份	10,900	40,221.00	0.09
32	000888	峨眉山 A	7,100	40,186.00	0.09
33	600153	建发股份	5,700	40,185.00	0.09
34	600765	中航重机	5,400	40,176.00	0.09
35	603729	龙韵股份	2,600	40,144.00	0.09
36	600222	太龙药业	11,800	40,120.00	0.09
37	600482	中国动力	1,800	40,086.00	0.09
38	002317	众生药业	4,800	40,080.00	0.09
39	600356	恒丰纸业	7,300	40,077.00	0.09
40	300217	东方电热	17,200	40,076.00	0.09
41	600880	博瑞传播	10,800	40,068.00	0.09
42	300291	华录百纳	9,000	40,050.00	0.09
43	600565	迪马股份	15,400	40,040.00	0.09
44	600582	天地科技	11,700	40,014.00	0.09
45	002380	科远股份	3,800	40,014.00	0.09
46	600787	中储股份	8,000	40,000.00	0.09
47	002637	赞宇科技	5,600	39,984.00	0.09
48	300235	方直科技	4,900	39,935.00	0.09
49	600665	天地源	11,600	39,904.00	0.09

50	603306	华懋科技	2,800	39,900.00	0.09
51	000716	黑芝麻	14,300	39,897.00	0.09
52	002325	洪涛股份	13,700	39,867.00	0.09
53	002082	万邦德	5,400	39,852.00	0.09
54	600710	苏美达	10,800	39,852.00	0.09
55	300089	文化长城	7,500	39,825.00	0.09
56	603888	新华网	3,100	39,804.00	0.09
57	300437	清水源	3,400	39,712.00	0.09
58	600257	大湖股份	9,500	39,710.00	0.09
59	002081	金螳螂	4,900	39,690.00	0.09
60	002406	远东传动	7,500	39,675.00	0.09
61	000021	深科技	6,900	39,675.00	0.09
62	300566	激智科技	3,000	39,600.00	0.09
63	000589	黔轮胎 A	11,800	39,530.00	0.09
64	600879	航天电子	7,300	39,493.00	0.09
65	002193	如意集团	4,500	39,420.00	0.09
66	601567	三星医疗	7,000	39,410.00	0.09
67	600830	香溢融通	8,200	39,278.00	0.09
68	002004	华邦健康	8,500	39,185.00	0.09
69	603968	醋化股份	3,100	39,184.00	0.09
70	600353	旭光股份	9,800	39,102.00	0.09
71	002391	长青股份	3,700	39,035.00	0.09
72	300136	信维通信	1,800	38,898.00	0.09
73	000581	威孚高科	2,200	38,852.00	0.09
74	600694	大商股份	1,600	38,704.00	0.09
75	300121	阳谷华泰	4,500	38,430.00	0.09
76	600854	春兰股份	10,300	35,844.00	0.08
77	601319	中国人保	6,288	33,829.44	0.08
78	300040	九洲电气	6,500	31,980.00	0.07
79	000619	海螺型材	6,000	31,140.00	0.07
80	600143	金发科技	5,800	28,710.00	0.07

81	600737	中粮糖业	3,900	28,704.00	0.07
82	600551	时代出版	3,300	28,446.00	0.06
83	600875	东方电气	3,600	28,404.00	0.06
84	600739	辽宁成大	2,700	28,242.00	0.06
85	600483	福能股份	3,300	28,050.00	0.06
86	300190	维尔利	5,700	28,044.00	0.06
87	300489	中飞股份	2,400	28,032.00	0.06
88	603886	元祖股份	1,600	28,000.00	0.06
89	002468	申通快递	1,700	27,965.00	0.06
90	000551	创元科技	4,800	27,888.00	0.06
91	603528	多伦科技	4,500	27,720.00	0.06
92	000978	桂林旅游	5,300	27,719.00	0.06
93	601339	百隆东方	5,000	27,650.00	0.06
94	600371	万向德农	4,400	27,500.00	0.06
95	002152	广电运通	4,900	27,489.00	0.06
96	000541	佛山照明	5,300	27,454.00	0.06
97	600790	轻纺城	7,500	27,375.00	0.06
98	600513	联环药业	4,600	27,370.00	0.06
99	603701	德宏股份	2,400	27,360.00	0.06
100	300330	华虹计通	3,900	27,261.00	0.06
101	603088	宁波精达	2,400	27,216.00	0.06
102	002688	金河生物	6,100	27,206.00	0.06
103	600561	江西长运	5,000	27,200.00	0.06
104	600537	亿晶光电	9,600	27,168.00	0.06
105	600881	亚泰集团	8,200	27,142.00	0.06
106	002083	孚日股份	5,500	27,115.00	0.06
107	000598	兴蓉环境	6,700	27,001.00	0.06
108	002454	松芝股份	6,600	26,994.00	0.06
109	300674	宇信科技	1,027	26,958.75	0.06
110	002561	徐家汇	3,500	26,950.00	0.06
111	600633	浙数文化	3,300	26,895.00	0.06

112	300026	红日药业	8,800	26,840.00	0.06
113	603198	迎驾贡酒	1,900	26,809.00	0.06
114	000425	徐工机械	8,300	26,809.00	0.06
115	600979	广安爱众	6,700	26,800.00	0.06
116	603669	灵康药业	2,700	26,730.00	0.06
117	601801	皖新传媒	4,000	26,720.00	0.06
118	600031	三一重工	3,200	26,688.00	0.06
119	002478	常宝股份	5,800	26,680.00	0.06
120	002037	久联发展	3,300	26,664.00	0.06
121	000862	银星能源	9,000	26,640.00	0.06
122	603887	城地股份	1,900	26,638.00	0.06
123	600177	雅戈尔	3,700	26,603.00	0.06
124	600586	金晶科技	9,400	26,602.00	0.06
125	600039	四川路桥	8,100	26,568.00	0.06
126	300421	力星股份	2,100	26,565.00	0.06
127	002615	哈尔斯	5,500	26,565.00	0.06
128	600017	日照港	9,600	26,496.00	0.06
129	601311	骆驼股份	3,000	26,490.00	0.06
130	300434	金石东方	3,000	26,400.00	0.06
131	600050	中国联通	5,100	26,367.00	0.06
132	002783	凯龙股份	4,100	26,363.00	0.06
133	600585	海螺水泥	900	26,352.00	0.06
134	600983	惠而浦	5,000	26,300.00	0.06
135	600969	郴电国际	4,400	26,092.00	0.06
136	002013	中航机电	4,000	26,040.00	0.06
137	600609	金杯汽车	8,400	26,040.00	0.06
138	603090	宏盛股份	2,000	25,960.00	0.06
139	300154	瑞凌股份	5,400	25,920.00	0.06
140	002661	克明面业	2,100	25,914.00	0.06
141	603355	莱克电气	1,200	25,800.00	0.06
142	600573	惠泉啤酒	4,100	25,789.00	0.06

143	600697	欧亚集团	1,400	25,746.00	0.06
144	002404	嘉欣丝绸	4,800	25,680.00	0.06
145	300275	梅安森	3,400	25,636.00	0.06
146	002373	千方科技	2,300	25,576.00	0.06
147	300556	丝路视觉	1,600	25,552.00	0.06
148	002088	鲁阳节能	3,000	25,410.00	0.06
149	603035	常熟汽饰	2,100	25,410.00	0.06
150	002771	真视通	2,300	25,392.00	0.06
151	000531	穗恒运 A	5,000	25,300.00	0.06
152	601231	环旭电子	2,800	25,200.00	0.06
153	000938	紫光股份	800	25,008.00	0.06
154	603168	莎普爱思	3,600	24,660.00	0.06
155	600037	歌华有线	2,800	24,052.00	0.05
156	002416	爱施德	3,800	22,344.00	0.05
157	603288	海天味业	300	20,640.00	0.05
158	600636	三爱富	1,800	19,422.00	0.04
159	000430	张家界	4,000	19,360.00	0.04
160	002729	好利来	900	18,540.00	0.04
161	603030	全筑股份	3,600	18,360.00	0.04
162	000028	国药一致	400	16,576.00	0.04
163	300375	鹏翎股份	2,900	15,689.00	0.04
164	300546	雄帝科技	600	15,540.00	0.04
165	603663	三祥新材	900	15,300.00	0.03
166	000702	正虹科技	2,700	15,012.00	0.03
167	300394	天孚通信	600	14,502.00	0.03
168	000848	承德露露	1,800	14,472.00	0.03
169	000695	滨海能源	1,600	14,400.00	0.03
170	600557	康缘药业	1,400	14,392.00	0.03
171	600587	新华医疗	1,100	14,366.00	0.03
172	300427	红相股份	1,300	14,352.00	0.03
173	000948	南天信息	1,500	14,310.00	0.03

174	601928	凤凰传媒	1,800	14,292.00	0.03
175	600113	浙江东日	2,000	14,260.00	0.03
176	300525	博思软件	600	14,244.00	0.03
177	000537	广宇发展	1,900	14,231.00	0.03
178	603918	金桥信息	1,200	14,220.00	0.03
179	002706	良信电器	2,300	14,191.00	0.03
180	300569	天能重工	1,100	14,135.00	0.03
181	300093	金刚玻璃	2,300	14,053.00	0.03
182	000617	中油资本	1,300	13,975.00	0.03
183	601168	西部矿业	2,400	13,968.00	0.03
184	300442	普丽盛	1,100	13,937.00	0.03
185	300383	光环新网	1,100	13,937.00	0.03
186	002244	滨江集团	3,500	13,930.00	0.03
187	000159	国际实业	3,300	13,926.00	0.03
188	600390	五矿资本	2,000	13,920.00	0.03
189	600861	北京城乡	2,000	13,900.00	0.03
190	600865	百大集团	2,500	13,875.00	0.03
191	600594	益佰制药	2,500	13,800.00	0.03
192	002559	亚威股份	2,100	13,797.00	0.03
193	600657	信达地产	3,500	13,755.00	0.03
194	002435	长江润发	2,600	13,754.00	0.03
195	002438	江苏神通	2,400	13,752.00	0.03
196	600081	东风科技	1,900	13,737.00	0.03
197	000050	深天马 A	1,400	13,734.00	0.03
198	600543	莫高股份	2,100	13,713.00	0.03
199	002274	华昌化工	2,700	13,689.00	0.03
200	000863	三湘印象	3,500	13,685.00	0.03
201	600481	双良节能	4,100	13,653.00	0.03
202	601966	玲珑轮胎	1,000	13,650.00	0.03
203	300254	仟源医药	2,100	13,608.00	0.03
204	002442	龙星化工	1,800	13,608.00	0.03

205	601607	上海医药	800	13,600.00	0.03
206	600617	国新能源	2,800	13,580.00	0.03
207	600780	通宝能源	4,200	13,566.00	0.03
208	600823	世茂股份	3,600	13,536.00	0.03
209	300405	科隆股份	1,800	13,536.00	0.03
210	002498	汉缆股份	6,800	13,532.00	0.03
211	600395	盘江股份	2,700	13,527.00	0.03
212	600366	宁波韵升	2,700	13,527.00	0.03
213	000402	金融街	2,100	13,524.00	0.03
214	000798	中水渔业	2,600	13,520.00	0.03
215	002392	北京利尔	4,200	13,440.00	0.03
216	002696	百洋股份	1,500	13,440.00	0.03
217	000417	合肥百货	3,100	13,423.00	0.03
218	000922	佳电股份	2,000	13,420.00	0.03
219	002627	宜昌交运	2,100	13,419.00	0.03
220	000078	海王生物	4,500	13,410.00	0.03
221	600829	人民同泰	2,300	13,409.00	0.03
222	300270	中威电子	2,100	13,398.00	0.03
223	603025	大豪科技	1,200	13,380.00	0.03
224	600888	新疆众和	3,200	13,376.00	0.03
225	300159	新研股份	2,900	13,369.00	0.03
226	000715	中兴商业	2,300	13,363.00	0.03
227	601018	宁波港	4,000	13,360.00	0.03
228	300470	日机密封	600	13,350.00	0.03
229	000767	漳泽电力	5,400	13,338.00	0.03
230	002682	龙洲股份	3,100	13,330.00	0.03
231	000756	新华制药	2,400	13,320.00	0.03
232	600006	东风汽车	3,700	13,320.00	0.03
233	300250	初灵信息	1,200	13,320.00	0.03
234	300017	网宿科技	1,700	13,311.00	0.03
235	603929	亚翔集成	900	13,302.00	0.03

236	600101	明星电力	2,000	13,300.00	0.03
237	600219	南山铝业	6,300	13,293.00	0.03
238	300227	光韵达	1,400	13,286.00	0.03
239	600558	大西洋	4,200	13,272.00	0.03
240	600160	巨化股份	2,000	13,260.00	0.03
241	600782	新钢股份	2,600	13,234.00	0.03
242	600509	天富能源	3,700	13,209.00	0.03
243	002566	益盛药业	2,300	13,202.00	0.03
244	600479	千金药业	1,700	13,192.00	0.03
245	300246	宝莱特	1,200	13,188.00	0.03
246	000012	南玻A	3,300	13,167.00	0.03
247	002312	三泰控股	4,200	13,146.00	0.03
248	300027	华谊兄弟	2,800	13,132.00	0.03
249	002728	特一药业	1,000	13,120.00	0.03
250	002360	同德化工	2,400	13,104.00	0.03
251	000698	沈阳化工	3,600	13,104.00	0.03
252	002361	神剑股份	3,600	13,104.00	0.03
253	601216	君正集团	5,000	13,100.00	0.03
254	000570	苏常柴A	3,500	13,090.00	0.03
255	002738	中矿资源	900	13,086.00	0.03
256	600731	湖南海利	3,100	13,082.00	0.03
257	300010	立思辰	1,800	13,068.00	0.03
258	000419	通程控股	3,200	13,056.00	0.03
259	002062	宏润建设	3,400	13,056.00	0.03
260	603369	今世缘	900	13,041.00	0.03
261	002487	大金重工	3,900	13,026.00	0.03
262	300058	蓝色光标	3,000	13,020.00	0.03
263	300552	万集科技	900	12,960.00	0.03
264	300239	东宝生物	3,500	12,950.00	0.03
265	600971	恒源煤电	2,300	12,949.00	0.03
266	601872	招商轮船	3,500	12,915.00	0.03

267	300324	旋极信息	2,300	12,903.00	0.03
268	600367	红星发展	1,800	12,888.00	0.03
269	603328	依顿电子	1,300	12,870.00	0.03
270	300182	捷成股份	3,000	12,870.00	0.03
271	002532	新界泵业	2,600	12,844.00	0.03
272	601233	桐昆股份	1,300	12,688.00	0.03
273	002111	威海广泰	1,300	12,662.00	0.03
274	300321	同大股份	1,000	12,650.00	0.03
275	600843	上工申贝	1,900	12,616.00	0.03
276	300460	惠伦晶体	1,500	12,555.00	0.03
277	002713	东易日盛	800	12,544.00	0.03
278	600361	华联综超	3,700	12,543.00	0.03
279	300389	艾比森	800	12,504.00	0.03
280	300088	长信科技	3,000	12,450.00	0.03
281	600419	天润乳业	900	12,384.00	0.03
282	000042	中洲控股	1,100	12,342.00	0.03
283	300423	鲁亿通	700	12,341.00	0.03
284	002601	龙蟠佰利	1,000	12,300.00	0.03
285	300530	达志科技	400	12,264.00	0.03
286	603869	新智认知	800	12,032.00	0.03
287	300146	汤臣倍健	700	11,893.00	0.03
288	600260	凯乐科技	700	11,879.00	0.03
289	600839	四川长虹	5,100	11,781.00	0.03
290	002815	崇达技术	800	11,688.00	0.03
291	603518	维格娜丝	800	11,280.00	0.03
292	603737	三棵树	300	10,908.00	0.02
293	600777	新潮能源	5,500	10,505.00	0.02
294	600386	北巴传媒	3,100	10,292.00	0.02
295	603228	景旺电子	200	9,998.00	0.02
296	603556	海兴电力	700	9,100.00	0.02
297	002613	北玻股份	2,900	7,714.00	0.02

298	000039	中集集团	700	7,406.00	0.02
299	000708	大冶特钢	800	7,016.00	0.02
300	000501	鄂武商 A	700	6,636.00	0.02
301	300329	海伦钢琴	900	6,363.00	0.01
302	002051	中工国际	500	5,540.00	0.01
303	600980	北矿科技	400	3,916.00	0.01
304	600028	中国石化	700	3,535.00	0.01

## 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。

#### 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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
创金 合信 中证1 000增 强A	1,072	25,205.09	5,000,166.70	18.51 %	22,019,684.97	81.49%
创金 合信	812	39,304.12	12,724,250.12	39.87 %	19,190,698.53	60.13%

中证1000增强C						
合计	1,824	32,310.75	17,724,416.82	30.07%	41,210,383.50	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	发起份额总数	发起份额占基金总份	发起份额承诺持有期限

		额比例		额比例	
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%	25,000,000.00	24.15%	-	-	-	-
第一创业证券	13,400,879.65	83.27%	78,500,000.00	75.85%	-	-	-	-

### 11.8 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	2018-01-02
2	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	公司官网、证券时报	2018-01-19
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、证券时报	2018-01-29
4	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报	2018-02-02
5	创金合信中证1000指数增强	公司官网、证券时报	2018-02-02

	型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）		
6	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、证券时报	2018-02-10
7	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
8	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（更新）摘要（2017年第2号）（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
9	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告	公司官网、证券时报	2018-03-28
10	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
11	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（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
12	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、证券时报	2018-03-29
13	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、证券时报	2018-03-30
14	创金合信中证1000指数增强	公司官网、证券时报	2018-03-31

	型发起式证券投资基金2017年年度报告		
15	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	公司官网、证券时报	2018-03-31
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、证券时报	2018-04-02
17	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第1季度报告	公司官网、证券时报	2018-04-19
18	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、证券时报	2018-04-27
19	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、证券时报	2018-05-17
20	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2018-05-24
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广发证券为代销机构暨参加广发证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2018-06-06
22	创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强A调整申购金额下限及最低持有金额下限的公告	公司官网、证券时报	2018-06-12
23	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、证券时报	2018-06-15

24	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、证券时报	2018-06-21
25	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、证券时报	2018-06-22
26	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增 加恒泰证券为代销机构的公 告	公司官网、证券时报	2018-06-29
27	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	2018-07-02
28	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、证券时报	2018-07-06
29	创金合信中证1000指数增强 型发起式证券投资基金2018 年第2季度报告	公司官网、证券时报	2018-07-20
30	创金合信中证1000指数增强 型发起式证券投资基金（20 18年第1号）招募说明书（ 更新）	公司官网、证券时报	2018-08-03
31	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（更新）摘要（2018 年第1号）	公司官网、证券时报	2018-08-03
32	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增 加长量基金为代销机构的公 告	公司官网、证券时报	2018-08-10
33	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增 加和耕传承为代销机构的公	公司官网、证券时报	2018-08-17

	告		
34	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年半年度报告	公司官网、证券时报	2018-08-29
35	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券时报	2018-09-01
36	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、证券时报	2018-09-11
37	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第3季度报告	公司官网、证券时报	2018-10-25
38	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植信基金为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-10-26
39	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中银国际证券为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-11-13
40	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阳光人寿为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-11-29
41	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腾安基金为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-12-07

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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	201801 01 - 2 018032 6	158,930,244. 65	0.00	158,930,244. 65	0.00	0.00%
	2	201802 08 - 2 018032 7	39,847,579.2 0	0.00	39,847,579.2 0	0.00	0.00%
	3	201803 28 - 2 018041 2, 2018 0828 - 201811 14, 201 81120 - 2018 1121	10,000,333.3 6	0.00	0.00	10,000,333 .36	16.97%
	4	201803 28 - 2 018070 8	0.00	20,839,564.7 5	20,839,564.7 5	0.00	0.00%

## 产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能会存在以下风险：

## 1、大额申购风险

在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

## 2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回

回，将可能对基金管理人的管理造成影响；

(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；

(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《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》；
- 2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、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。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 13.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年三月二十九日