

创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数	
基金主代码	005567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,025,700.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567	005568
报告期末下属分级基金的份额总额	55,545,025.71份	15,480,674.66份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

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

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	创金合信MSCI中国A股国际 指数A	创金合信MSCI中国A股国际 指数C
本期已实现收益	922,721.63	245,845.48
本期利润	13,677,596.15	3,890,114.24
加权平均基金份额本期 利润	0.2318	0.2283
本期加权平均净值利润 率	24.72%	24.42%
本期基金份额净值增长 率	26.83%	26.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,107,517.62	-356,034.16
期末可供分配基金份额 利润	-0.0199	-0.0230
期末基金资产净值	55,583,075.22	15,439,480.24
期末基金份额净值	1.0007	0.9973
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长 率	0.07%	-0.27%

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MSCI中国A股国际指数A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.29%	1.10%	4.82%	1.26%	0.47%	-0.16%
过去三个月	-0.26%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.95%	-0.15%
过去六个月	26.83%	1.44%	23.75%	1.55%	3.08%	-0.11%
过去一年	10.62%	1.43%	3.26%	1.56%	7.36%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	0.07%	1.33%	-17.43%	1.47%	17.50%	-0.14%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.27%	1.10%	4.82%	1.26%	0.45%	-0.16%
过去三个月	-0.32%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.89%	-0.15%
过去六个月	26.67%	1.44%	23.75%	1.55%	2.92%	-0.11%
过去一年	10.33%	1.43%	3.26%	1.56%	7.07%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	-0.27%	1.33%	-17.43%	1.47%	17.16%	-0.14%

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



注：本基金的合同生效日为2018年2月7日，本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。

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。

截至2019年6月30日，本公司共管理40只公募基金，其中混合型产品8只、指数型产品8只、债券型产品14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155.17亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	-	11年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UC LA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任指数

					策略投资研究部副总监、 基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------

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

2、证券从业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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数，业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的，考虑了境外投资者投资A股的相关限制（外资投资比例）和流动性因素（换手率等指标），入选的样本股主要为大中盘股票，其总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为55%左右。本基金的投资策略，正常情况下主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为1.0007元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.83%，同期业绩比较基准收益率为23.75%；截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为0.9973元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.67%，同期业绩比较基准收益率为23.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期中美贸易谈判重启，摩擦有所缓和，但中美合作有限、竞争加剧的态势将长期存在。短期给出口部门和企业带来下行压力，但长期给国内经济转型升级带来动力；科创板加速落地，带动部分基础性制度革新，利好资本市场长远发展；经过二季度回调，A股整体估值处于中低位水平，具备长期投资价值。此外，MSCI按既定计划进一步提升国际指数中的A股权重，这有助于引入更多境外资金进入A股市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,741,877.57	1,865,175.94
结算备付金		423,359.45	163,034.63
存出保证金		120,858.99	95,516.98
交易性金融资产	6.4.7.2	68,729,263.27	63,147,040.42
其中：股票投资		65,727,463.27	60,133,840.42
基金投资		-	-
债券投资		3,001,800.00	3,013,200.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		76,129.03	-
应收利息	6.4.7.5	75,922.84	84,355.38
应收股利		-	-
应收申购款		159,930.87	34,470.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		71,327,342.02	65,389,593.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		181,451.52	241,004.88
应付管理人报酬		28,109.35	28,456.64
应付托管费		5,621.89	5,691.31
应付销售服务费		2,511.00	2,565.16
应付交易费用	6.4.7.7	15,598.10	2,515.35
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	71,494.70	201,951.22
负债合计		304,786.56	482,184.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	71,025,700.37	82,306,992.26

未分配利润	6.4.7.10	-3,144.91	-17,399,583.22
所有者权益合计		71,022,555.46	64,907,409.04
负债和所有者权益总计		71,327,342.02	65,389,593.60

注：1. 报告截止日2019年6月30日，基金份额总额71,025,700.37份，其中下属A类基金份额55,545,025.71份，C类基金份额15,480,674.66份。下属A类基金份额净值1.0007元，C类基金份额净值0.9973元。

2. 本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入		17,921,644.36	-8,998,994.08
1. 利息收入		57,791.40	48,279.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,096.62	30,156.66
债券利息收入		49,694.78	18,123.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,443,737.55	710,548.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	588,740.92	-165,876.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-8,095.80	-

资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	162,873.79	-
股利收益	6.4.7.15	700,218.64	876,424.58
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	16,399,143.28	-9,790,995.66
4. 汇兑收益（损失以“- ”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“- ”号填列）	6.4.7.17	20,972.13	33,173.63
减：二、费用		353,933.97	385,602.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	176,301.31	163,601.72
2. 托管费	6.4.10.2. 2	35,260.30	32,720.33
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	15,772.03	11,949.98
4. 交易费用	6.4.7.18	46,153.54	79,095.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		586.34	-
7. 其他费用	6.4.7.19	79,860.45	98,234.96
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		17,567,710.39	-9,384,596.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“- ”号填列）		17,567,710.39	-9,384,596.61

注：本基金合同生效日为2018年2月7日，上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	82,306,992.26	-17,399,583.22	64,907,409.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,567,710.39	17,567,710.39
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)	-11,281,291.89	-171,272.08	-11,452,563.97
其中：1. 基金申购款	11,997,933.57	-472,673.49	11,525,260.08
2. 基金赎回款	-23,279,225.46	301,401.41	-22,977,824.05
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)	71,025,700.37	-3,144.91	71,022,555.46
项 目	上年度可比期间 2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	68,378,462.98	-	68,378,462.98
二、本期经营活动产生的基金净值变	-	-9,384,596.61	-9,384,596.61

动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	27,452,583.46	229,412.31	27,681,995.77
其中: 1. 基金申购款	37,033,930.70	274.10	37,034,204.80
2. 基金赎回款	-9,581,347.24	229,138.21	-9,352,209.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	95,831,046.44	-9,155,184.30	86,675,862.14

注: 本基金合同生效日为2018年2月7日, 上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2442号《关于准予创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币68,365,796.39元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金

合同》于2018年2月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为68,378,462.98份基金份额，其中认购资金利息折合12,666.59份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,900.09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MSCI中国A股国际指数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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成分股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、货币市场工具、金融衍生品（包括权证、股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金的业绩比较基准为：MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019半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2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	1,741,877.57
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	1,741,877.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	65,741,719.95	65,727,463.27	-14,256.68	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	3,007,491.97	3,001,800.00	-5,691.97
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,007,491.97	3,001,800.00	-5,691.97
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	68,749,211.92	68,729,263.27	-19,948.65	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,116,660.00	-	-	-
—股指期货	1,116,660.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,116,660.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	292.02
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	175.57
应收债券利息	75,452.05
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	3.20
合计	75,922.84

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	15,598.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	15,598.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30.45
预提费用	71,464.25
合计	71,494.70

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数A)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	63,735,597.38	63,735,597.38
本期申购	8,715,194.44	8,715,194.44
本期赎回（以“-”号填列）	-16,905,766.11	-16,905,766.11
本期末	55,545,025.71	55,545,025.71

6.4.7.9.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,571,394.88	18,571,394.88
本期申购	3,282,739.13	3,282,739.13
本期赎回（以“-”号填列）	-6,373,459.35	-6,373,459.35
本期末	15,480,674.66	15,480,674.66

注：申购含红利再投、转换入份(金额)，赎回含转换出份(金额)。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,338,180.03	-11,110,633.15	-13,448,813.18
本期利润	922,721.63	12,754,874.52	13,677,596.15
本期基金份额交易产生的变动数	307,940.78	-498,674.24	-190,733.46
其中：基金申购款	-283,392.53	-54,434.77	-337,827.30
基金赎回款	591,333.31	-444,239.47	147,093.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,107,517.62	1,145,567.13	38,049.51

6.4.7.10.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-716,799.44	-3,233,970.60	-3,950,770.04
本期利润	245,845.48	3,644,268.76	3,890,114.24
本期基金份额交易产 生的变动数	114,919.80	-95,458.42	19,461.38
其中：基金申购款	-118,238.48	-16,607.71	-134,846.19
基金赎回款	233,158.28	-78,850.71	154,307.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-356,034.16	314,839.74	-41,194.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	5,600.35
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	2,460.21
其他	36.06
合计	8,096.62

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	21,563,762.11
减：卖出股票成本总额	20,975,021.19
买卖股票差价收入	588,740.92

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30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	-8,095.80
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	-8,095.80

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,108,729.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,008,395.80
减：应收利息总额	108,429.03
买卖债券差价收入	-8,095.80

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无权证收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年01月01日至2019年06月30日
期货投资	162,873.79

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	700,218.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	700,218.64

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	16,331,463.28
——股票投资	16,341,959.45
——债券投资	-10,496.17
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	67,680.00
——权证投资	-
——期货投资	67,680.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	16,399,143.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	20,472.81
转换费收入	499.32
合计	20,972.13

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	46,095.60
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	57.94
合计	46,153.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	49,721.12
汇划手续费	1,678.05
指数使用费	13,584.89
合计	79,860.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

经创金合信基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会（证监许可〔2018〕2082号）核准，本公司进行增资扩股。公司注册资本由17,000万元增加至23,300万元，增额注册资本已由新增股东深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）、深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）认购并已实缴。本公司《公司章程》的有关条款已根据本次增资情况进行了相应修改。上述事项的工商变更登记手续现已于2019年4月29日办理完毕。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日

	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	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	30,078,187.11	99.05%	88,882,277.34	92.01%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日 ）至2018年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	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	6,007,791.97	100.00%	3,010,194.40	75.04%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
第一创业	21,750.67	99.56%	15,598.10	100.00%

证券股份 有限公司				
关联方名 称	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
第一创业 证券股份 有限公司	64,399.83	95.16%	5,270.52	61.68%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,301.31	163,601.72
其中：支付销售机构的客户维护费	83,096.54	72,009.67

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,260.30	32,720.33

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指 数A	创金合信MSCI中国A股国际指 数C	合计
招商银行	0.00	4,235.80	4,235.80
第一创业 证券	0.00	69.13	69.13
创金合信 直销	0.00	4,643.20	4,643.20
合计	0.00	8,948.13	8,948.13
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
创金合信直销	0.00	3,840.56	3,840.56
第一创业证券	0.00	0.65	0.65
招商银行	0.00	2,626.34	2,626.34
合计	0.00	6,467.55	6,467.55

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信MSCI中国A股国际指数A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日

基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	-	5,000,450.09
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.00%	6.44%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年02月07日）持有的基金份额	-	5,000,450.00
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.30%	27.42%
---------------------	--------	--------

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年02月07日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,741,877.57	5,600.35	1,306,591.56	28,264.82

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2019年6月30日，本基金持有53,600.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币1,546,170.21元，估值总额为1,928,528.00元，占基金资产净值比例为2.72%；本基金持有9,000.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币48,577.00元，估值总额为57,060.00元。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量（	期末	期末	备注

代码	名称	认购 日	通日	受限 类型	价格	估值 单价	单位： (股)	成本 总额	估值 总额	
6012 36	红塔 证券	2019 -06- 26	2019 -07- 05	新发 流通 受限	3.46	3.46	9,789	33,8 69.9 4	33,8 69.9 4	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手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招商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所(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。

6.4.13.2.1 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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,001,800.00	-
合计	3,001,800.00	-

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	3,013,200.00
合计	-	3,013,200.00

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回

申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2019年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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6.4.12。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2019年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.21%。

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2019年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为71,060,552.26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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,741,877.57	-	-	-	1,741,877.57
结算备付金	423,359.45	-	-	-	423,359.45
存出保证金	120,858.99	-	-	-	120,858.99
交易性金融资产	3,001,800.00	-	-	65,727,463.27	68,729,263.27
应收证券清算	-	-	-	76,129.03	76,129.03

款					
应收利息	-	-	-	75,922.84	75,922.84
应收申购款	-	-	-	159,930.87	159,930.87
资产总计	5,287,896.01	-	-	66,039,446.01	71,327,342.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	181,451.52	181,451.52
应付管理人报酬	-	-	-	28,109.35	28,109.35
应付托管费	-	-	-	5,621.89	5,621.89
应付销售服务费	-	-	-	2,511.00	2,511.00
应付交易费用	-	-	-	15,598.10	15,598.10
其他负债	-	-	-	71,494.70	71,494.70
负债总计	-	-	-	304,786.56	304,786.56
利率敏感度缺口	5,287,896.01	-	-	65,734,659.45	71,022,555.46
上年度末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	1,865,175.94	-	-	-	1,865,175.94
结算备付金	163,034.63	-	-	-	163,034.63
存出保证金	95,516.98	-	-	-	95,516.98
交易性	3,013,200.00	-	-	60,133,840.42	63,147,040.42

金融资产					
应收利息	-	-	-	84,355.38	84,355.38
应收申购款	-	-	-	34,470.25	34,470.25
资产总计	5,136,927.55	-	-	60,252,666.05	65,389,593.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	241,004.88	241,004.88
应付管理人报酬	-	-	-	28,456.64	28,456.64
应付托管费	-	-	-	5,691.31	5,691.31
应付销售服务费	-	-	-	2,565.16	2,565.16
应付交易费用	-	-	-	2,515.35	2,515.35
其他负债	-	-	-	201,951.22	201,951.22
负债总计	-	-	-	482,184.56	482,184.56
利率敏感度缺口	5,136,927.55	-	-	59,770,481.49	64,907,409.04

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年6月30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4.23%(2018年12月31日:4.64%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日:同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018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	65,727,463.27	92.54	60,133,840.42	92.65
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	65,727,463.27	92.54	60,133,840.42	92.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	3,345,003.84	3,063,897.21
	比较基准下降5%资产净值变动	-3,345,003.84	-3,063,897.21

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为65,693,593.33元，属于第二层次的余额为3,035,669.94元，无属于第三层次的余额。（2018年12月31日：第一层次59,592,255.42元，第二层次3,554,785.00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2019年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	65,727,463.27	92.15
	其中：股票	65,727,463.27	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,001,800.00	4.21
	其中：债券	3,001,800.00	4.21
	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	2,165,237.02	3.04
8	其他各项资产	432,841.73	0.61
9	合计	71,327,342.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
)

A	农、林、牧、渔业	875,817.60	1.23
B	采矿业	2,360,981.60	3.32
C	制造业	28,524,922.01	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,840,683.00	2.59
E	建筑业	1,674,629.00	2.36
F	批发和零售业	1,427,335.60	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,070,773.20	2.92
H	住宿和餐饮业	79,446.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,985,258.35	4.20
J	金融业	18,384,550.20	25.89
K	房地产业	3,281,738.00	4.62
L	租赁和商务服务业	844,255.40	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	105,543.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	448,936.70	0.63
R	文化、体育和娱乐业	412,450.00	0.58
S	综合	178,509.00	0.25
	合计	65,495,828.66	92.22

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	45,848.25	0.06
C	制造业	118,384.74	0.17

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	33,531.68	0.05
J	金融业	33,869.94	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	231,634.61	0.33

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,300	3,247,200.00	4.57

2	601318	中国平安	28,200	2,498,802.00	3.52
3	600036	招商银行	53,600	1,928,528.00	2.72
4	000858	五粮液	10,100	1,191,295.00	1.68
5	601166	兴业银行	53,900	985,831.00	1.39
6	600000	浦发银行	76,200	890,016.00	1.25
7	601398	工商银行	139,900	824,011.00	1.16
8	600276	恒瑞医药	11,560	762,960.00	1.07
9	000002	万科A	25,300	703,593.00	0.99
10	601288	农业银行	193,200	695,520.00	0.98
11	600900	长江电力	38,100	681,990.00	0.96
12	002415	海康威视	24,300	670,194.00	0.94
13	601668	中国建筑	108,900	626,175.00	0.88
14	601328	交通银行	101,800	623,016.00	0.88
15	603288	海天味业	5,900	619,500.00	0.87
16	000001	平安银行	44,600	614,588.00	0.87
17	600030	中信证券	25,500	607,155.00	0.85
18	601601	中国太保	16,300	595,113.00	0.84
19	600016	民生银行	91,980	584,073.00	0.82
20	000333	美的集团	10,382	538,410.52	0.76
21	600887	伊利股份	15,800	527,878.00	0.74
22	600104	上汽集团	20,200	515,100.00	0.73
23	601766	中国中车	63,100	510,479.00	0.72
24	600050	中国联通	80,500	495,880.00	0.70
25	300498	温氏股份	13,800	494,868.00	0.70
26	002304	洋河股份	4,000	486,240.00	0.68
27	601888	中国国旅	5,100	452,115.00	0.64
28	600585	海螺水泥	10,400	431,600.00	0.61
29	000651	格力电器	7,800	429,000.00	0.60
30	600048	保利地产	30,900	394,284.00	0.56
31	601818	光大银行	103,200	393,192.00	0.55
32	601688	华泰证券	17,000	379,440.00	0.53

33	600028	中国石化	66,000	361,020.00	0.51
34	601211	国泰君安	19,500	357,825.00	0.50
35	001979	招商蛇口	17,100	357,390.00	0.50
36	601988	中国银行	91,000	340,340.00	0.48
37	601229	上海银行	28,340	335,829.00	0.47
38	601989	中国重工	59,300	329,708.00	0.46
39	002142	宁波银行	13,500	327,240.00	0.46
40	601169	北京银行	54,800	323,868.00	0.46
41	600019	宝钢股份	48,100	312,650.00	0.44
42	601006	大秦铁路	38,500	311,465.00	0.44
43	000568	泸州老窖	3,800	307,154.00	0.43
44	000725	京东方 A	87,700	301,688.00	0.42
45	600837	海通证券	21,000	297,990.00	0.42
46	601336	新华保险	5,400	297,162.00	0.42
47	601186	中国铁建	29,800	296,510.00	0.42
48	000063	中兴通讯	8,900	289,517.00	0.41
49	601857	中国石油	41,900	288,272.00	0.41
50	002024	苏宁易购	24,100	276,668.00	0.39
51	600690	海尔智家	15,800	273,182.00	0.38
52	002475	立讯精密	10,730	265,996.70	0.37
53	600031	三一重工	20,200	264,216.00	0.37
54	600015	华夏银行	33,200	255,640.00	0.36
55	600340	华夏幸福	7,800	254,046.00	0.36
56	601933	永辉超市	24,800	253,208.00	0.36
57	600999	招商证券	14,800	252,932.00	0.36
58	300015	爱尔眼科	8,030	248,689.10	0.35
59	000166	申万宏源	48,600	243,486.00	0.34
60	002594	比亚迪	4,700	238,384.00	0.34
61	601155	新城控股	5,900	234,879.00	0.33
62	601088	中国神华	11,400	232,332.00	0.33
63	300059	东方财富	16,900	228,995.00	0.32

64	000538	云南白药	2,700	225,234.00	0.32
65	600406	国电南瑞	11,900	221,816.00	0.31
66	601012	隆基股份	9,448	218,343.28	0.31
67	600919	江苏银行	29,900	217,074.00	0.31
68	002714	牧原股份	3,640	213,995.60	0.30
69	000776	广发证券	15,300	210,222.00	0.30
70	600009	上海机场	2,500	209,450.00	0.29
71	601628	中国人寿	7,200	203,904.00	0.29
72	002027	分众传媒	37,960	200,808.40	0.28
73	601225	陕西煤业	21,600	199,584.00	0.28
74	600010	宝钢股份	117,800	199,082.00	0.28
75	600547	山东黄金	4,800	197,616.00	0.28
76	000338	潍柴动力	15,500	190,495.00	0.27
77	000876	新希望	10,900	189,333.00	0.27
78	601985	中国核电	33,500	186,260.00	0.26
79	601939	建设银行	24,800	184,512.00	0.26
80	600436	片仔癀	1,600	184,320.00	0.26
81	002230	科大讯飞	5,450	181,158.00	0.26
82	601009	南京银行	21,900	180,894.00	0.25
83	603993	洛阳钼业	45,600	180,576.00	0.25
84	300760	迈瑞医疗	1,100	179,520.00	0.25
85	600741	华域汽车	8,200	177,120.00	0.25
86	000895	双汇发展	7,100	176,719.00	0.25
87	601669	中国电建	32,900	174,041.00	0.25
88	600588	用友网络	6,425	172,704.00	0.24
89	600029	南方航空	22,200	171,384.00	0.24
90	000661	长春高新	500	169,000.00	0.24
91	601899	紫金矿业	44,600	168,142.00	0.24
92	600958	东方证券	15,400	164,472.00	0.23
93	600809	山西汾酒	2,300	158,815.00	0.22
94	600115	东方航空	25,300	158,631.00	0.22

95	600332	白云山	3,700	151,589.00	0.21
96	601901	方正证券	21,300	151,443.00	0.21
97	300122	智飞生物	3,500	150,850.00	0.21
98	600018	上港集团	22,000	150,040.00	0.21
99	000069	华侨城 A	21,200	147,340.00	0.21
100	600606	绿地控股	20,900	142,747.00	0.20
101	600438	通威股份	10,100	142,006.00	0.20
102	601618	中国中冶	46,000	139,840.00	0.20
103	600383	金地集团	11,700	139,581.00	0.20
104	002736	国信证券	10,600	139,496.00	0.20
105	300033	同花顺	1,400	137,704.00	0.19
106	600886	国投电力	17,500	135,975.00	0.19
107	600352	浙江龙盛	8,400	132,468.00	0.19
108	601600	中国铝业	33,700	132,104.00	0.19
109	600893	航发动力	5,800	131,718.00	0.19
110	600196	复星医药	5,200	131,560.00	0.19
111	300750	宁德时代	1,900	130,872.00	0.18
112	601877	正泰电器	5,600	129,304.00	0.18
113	600795	国电电力	50,600	128,524.00	0.18
114	600061	国投资本	9,100	127,491.00	0.18
115	002311	海大集团	4,100	126,690.00	0.18
116	600705	中航资本	23,100	125,202.00	0.18
117	601138	工业富联	10,200	122,910.00	0.17
118	600111	北方稀土	9,400	120,696.00	0.17
119	000596	古井贡酒	1,000	118,510.00	0.17
120	600703	三安光电	10,500	118,440.00	0.17
121	000963	华东医药	4,560	118,377.60	0.17
122	600660	福耀玻璃	5,200	118,196.00	0.17
123	601377	兴业证券	17,300	116,602.00	0.16
124	000100	TCL 集团	34,900	116,217.00	0.16
125	601788	光大证券	10,100	115,342.00	0.16

126	002007	华兰生物	3,750	114,337.50	0.16
127	002032	苏泊尔	1,500	113,745.00	0.16
128	300142	沃森生物	4,000	113,440.00	0.16
129	000768	中航飞机	7,200	113,400.00	0.16
130	002422	科伦药业	3,800	112,974.00	0.16
131	002236	大华股份	7,700	111,804.00	0.16
132	000783	长江证券	14,200	110,902.00	0.16
133	600271	航天信息	4,800	110,640.00	0.16
134	002202	金风科技	8,900	110,627.00	0.16
135	600926	杭州银行	13,240	110,289.20	0.16
136	601727	上海电气	20,200	108,676.00	0.15
137	601021	春秋航空	2,400	108,000.00	0.15
138	002001	新和成	5,530	106,673.70	0.15
139	600482	中国动力	4,500	106,290.00	0.15
140	300003	乐普医疗	4,600	105,892.00	0.15
141	603899	晨光文具	2,400	105,528.00	0.15
142	002352	顺丰控股	3,100	105,276.00	0.15
143	002146	荣盛发展	11,200	105,168.00	0.15
144	600085	同仁堂	3,600	104,400.00	0.15
145	600023	浙能电力	23,400	103,428.00	0.15
146	603589	口子窖	1,600	103,072.00	0.15
147	601108	财通证券	9,300	102,114.00	0.14
148	002157	正邦科技	6,100	101,626.00	0.14
149	600674	川投能源	11,400	101,460.00	0.14
150	300347	泰格医药	1,300	100,230.00	0.14
151	002044	美年健康	8,040	100,017.60	0.14
152	000703	恒逸石化	7,300	99,718.00	0.14
153	601018	宁波港	22,600	99,214.00	0.14
154	000157	中联重科	16,500	99,165.00	0.14
155	601111	中国国航	10,300	98,571.00	0.14
156	300124	汇川技术	4,299	98,490.09	0.14

157	600004	白云机场	5,400	98,280.00	0.14
158	600346	恒力石化	7,980	97,036.80	0.14
159	002410	广联达	2,900	95,381.00	0.13
160	002916	深南电路	920	93,766.40	0.13
161	600297	广汇汽车	21,000	93,660.00	0.13
162	600637	东方明珠	8,840	93,173.60	0.13
163	000860	顺鑫农业	1,980	92,367.00	0.13
164	603369	今世缘	3,300	92,037.00	0.13
165	002493	荣盛石化	7,600	91,656.00	0.13
166	600489	中金黄金	8,900	91,403.00	0.13
167	601607	上海医药	5,000	90,750.00	0.13
168	002673	西部证券	9,000	90,720.00	0.13
169	600872	中炬高新	2,100	89,943.00	0.13
170	600600	青岛啤酒	1,800	89,874.00	0.13
171	000425	徐工机械	20,100	89,646.00	0.13
172	300601	康泰生物	1,700	89,250.00	0.13
173	002179	中航光电	2,660	89,003.60	0.13
174	300144	宋城演艺	3,800	87,932.00	0.12
175	002271	东方雨虹	3,880	87,920.80	0.12
176	300408	三环集团	4,500	87,525.00	0.12
177	601998	中信银行	14,600	87,162.00	0.12
178	002506	协鑫集成	13,000	86,840.00	0.12
179	600170	上海建工	22,900	86,104.00	0.12
180	603833	欧派家居	800	86,096.00	0.12
181	600176	中国巨石	9,020	85,960.60	0.12
182	600362	江西铜业	5,400	84,996.00	0.12
183	601198	东兴证券	7,100	84,348.00	0.12
184	600516	方大炭素	6,854	84,235.66	0.12
185	600498	烽火通信	3,000	83,580.00	0.12
186	601919	中远海控	16,600	83,332.00	0.12
187	002153	石基信息	2,300	83,237.00	0.12

188	000961	中南建设	9,600	83,136.00	0.12
189	002371	北方华创	1,200	83,100.00	0.12
190	600183	生益科技	5,500	82,775.00	0.12
191	000656	金科股份	13,700	82,611.00	0.12
192	601838	成都银行	9,300	82,119.00	0.12
193	002405	四维图新	5,100	82,110.00	0.12
194	600895	张江高科	4,000	82,080.00	0.12
195	600177	雅戈尔	12,840	81,534.00	0.11
196	000709	河钢股份	27,200	81,328.00	0.11
197	600688	上海石化	15,700	81,012.00	0.11
198	600487	亨通光电	4,820	80,783.20	0.11
199	600867	通化东宝	5,240	80,696.00	0.11
200	601992	金隅集团	21,400	80,464.00	0.11
201	601800	中国交建	7,100	80,372.00	0.11
202	000728	国元证券	8,700	79,779.00	0.11
203	000786	北新建材	4,400	79,772.00	0.11
204	601555	东吴证券	7,700	78,925.00	0.11
205	000977	浪潮信息	3,300	78,738.00	0.11
206	002601	龙蟠佰利	5,300	78,599.00	0.11
207	000066	中国长城	7,600	78,128.00	0.11
208	300450	先导智能	2,300	77,280.00	0.11
209	600011	华能国际	12,300	76,629.00	0.11
210	601117	中国化学	12,700	76,454.00	0.11
211	002466	天齐锂业	3,000	75,840.00	0.11
212	600109	国金证券	7,800	75,816.00	0.11
213	002050	三花智控	7,170	75,643.50	0.11
214	600875	东方电气	7,100	75,402.00	0.11
215	002049	紫光国微	1,700	74,987.00	0.11
216	300628	亿联网络	700	74,949.00	0.11
217	601360	三六零	3,500	74,830.00	0.11
218	002555	三七互娱	5,500	74,525.00	0.10

219	600989	宝丰能源	6,300	74,403.00	0.10
220	600066	宇通客车	5,700	74,214.00	0.10
221	300413	芒果超媒	1,800	73,890.00	0.10
222	002241	歌尔股份	8,300	73,787.00	0.10
223	600068	葛洲坝	11,800	73,514.00	0.10
224	000999	华润三九	2,500	73,350.00	0.10
225	601233	桐昆股份	4,700	72,897.00	0.10
226	600522	中天科技	7,900	72,443.00	0.10
227	601100	恒立液压	2,300	72,174.00	0.10
228	000413	东旭光电	14,000	71,960.00	0.10
229	600369	西南证券	14,500	71,630.00	0.10
230	601997	贵阳银行	8,260	71,449.00	0.10
231	002926	华西证券	6,800	71,400.00	0.10
232	000050	深天马 A	5,300	71,232.00	0.10
233	002081	金螳螂	6,900	71,139.00	0.10
234	601216	君正集团	21,600	71,064.00	0.10
235	002372	伟星新材	4,080	70,992.00	0.10
236	600801	华新水泥	3,500	70,875.00	0.10
237	002127	南极电商	6,300	70,812.00	0.10
238	600816	安信信托	14,020	70,801.00	0.10
239	600642	申能股份	11,700	70,317.00	0.10
240	002129	中环股份	7,200	70,272.00	0.10
241	600118	中国卫星	3,100	69,905.00	0.10
242	600398	海澜之家	7,700	69,839.00	0.10
243	600536	中国软件	1,300	69,771.00	0.10
244	600760	中航沈飞	2,400	69,672.00	0.10
245	002600	领益智造	11,700	69,381.00	0.10
246	603986	兆易创新	800	69,360.00	0.10
247	600161	天坛生物	2,736	69,084.00	0.10
248	600208	新潮中宝	22,000	69,080.00	0.10
249	600219	南山铝业	30,550	69,043.00	0.10

250	600089	特变电工	9,500	68,875.00	0.10
251	000627	天茂集团	10,600	68,794.00	0.10
252	600100	同方股份	7,600	68,780.00	0.10
253	300529	健帆生物	1,100	68,585.00	0.10
254	600188	兖州煤业	6,300	68,481.00	0.10
255	002299	圣农发展	2,700	68,364.00	0.10
256	000938	紫光股份	2,504	68,234.00	0.10
257	600655	豫园股份	8,300	67,977.00	0.10
258	300017	网宿科技	6,300	67,914.00	0.10
259	002508	老板电器	2,500	67,850.00	0.10
260	000423	东阿阿胶	1,700	67,694.00	0.10
261	601872	招商轮船	15,500	67,580.00	0.10
262	000671	阳光城	10,400	67,392.00	0.09
263	000975	银泰资源	5,100	67,269.00	0.09
264	300383	光环新网	4,000	67,080.00	0.09
265	300014	亿纬锂能	2,200	67,012.00	0.09
266	002460	赣锋锂业	2,850	66,775.50	0.09
267	601238	广汽集团	6,100	66,673.00	0.09
268	600298	安琪酵母	2,100	66,423.00	0.09
269	000625	长安汽车	10,000	66,300.00	0.09
270	000630	铜陵有色	26,900	66,174.00	0.09
271	600779	水井坊	1,300	66,066.00	0.09
272	600497	驰宏锌锗	13,000	66,040.00	0.09
273	601878	浙商证券	7,100	66,030.00	0.09
274	600528	中铁工业	5,700	65,949.00	0.09
275	600038	中直股份	1,600	65,632.00	0.09
276	600027	华电国际	17,400	65,598.00	0.09
277	002373	千方科技	3,800	64,980.00	0.09
278	600153	建发股份	7,300	64,824.00	0.09
279	600535	天士力	3,880	64,214.00	0.09
280	002507	涪陵榨菜	2,100	64,050.00	0.09

281	002223	鱼跃医疗	2,600	64,012.00	0.09
282	002013	中航机电	9,250	63,640.00	0.09
283	002558	巨人网络	3,500	63,595.00	0.09
284	002180	纳思达	2,800	63,280.00	0.09
285	600583	海油工程	11,300	63,280.00	0.09
286	002010	传化智联	8,400	63,252.00	0.09
287	600566	济川药业	2,100	63,231.00	0.09
288	300070	碧水源	8,100	63,099.00	0.09
289	600845	宝信软件	2,210	62,940.80	0.09
290	600977	中国电影	4,000	62,640.00	0.09
291	600426	华鲁恒升	4,200	62,412.00	0.09
292	601099	太平洋	17,400	61,944.00	0.09
293	002439	启明星辰	2,300	61,870.00	0.09
294	600256	广汇能源	17,360	61,801.60	0.09
295	000401	冀东水泥	3,500	61,635.00	0.09
296	601699	潞安环能	7,700	61,138.00	0.09
297	300136	信维通信	2,500	61,125.00	0.09
298	300024	机器人	4,000	60,920.00	0.09
299	600909	华安证券	9,300	60,822.00	0.09
300	603858	步长制药	2,350	60,559.50	0.09
301	600673	东阳光	7,700	60,445.00	0.09
302	600155	华创阳安	4,500	60,435.00	0.09
303	000402	金融街	7,700	60,368.00	0.08
304	603885	吉祥航空	4,600	60,260.00	0.08
305	002384	东山精密	4,100	59,737.00	0.08
306	600704	物产中大	11,000	59,620.00	0.08
307	300253	卫宁健康	4,200	59,556.00	0.08
308	002624	完美世界	2,300	59,363.00	0.08
309	600998	九州通	4,800	59,328.00	0.08
310	002500	山西证券	7,300	59,130.00	0.08
311	600376	首开股份	6,600	58,938.00	0.08

312	603799	华友钴业	2,756	58,730.36	0.08
313	300433	蓝思科技	8,400	58,548.00	0.08
314	600021	上海电力	6,700	58,156.00	0.08
315	601098	中南传媒	4,600	58,144.00	0.08
316	002110	三钢闽光	6,250	58,125.00	0.08
317	002353	杰瑞股份	2,500	57,750.00	0.08
318	002385	大北农	10,900	57,661.00	0.08
319	600776	东方通信	2,500	57,450.00	0.08
320	002195	二三四五	14,755	57,396.95	0.08
321	600415	小商品城	13,900	57,268.00	0.08
322	002797	第一创业	9,000	57,060.00	0.08
323	600739	辽宁成大	3,900	56,706.00	0.08
324	002399	海普瑞	2,700	56,673.00	0.08
325	600460	士兰微	3,400	56,440.00	0.08
326	600372	中航电子	3,800	56,392.00	0.08
327	002465	海格通信	5,900	56,286.00	0.08
328	600315	上海家化	1,800	56,070.00	0.08
329	002065	东华软件	8,000	55,920.00	0.08
330	600959	江苏有线	12,560	55,892.00	0.08
331	601106	中国一重	17,500	54,950.00	0.08
332	601866	中远海发	20,200	54,944.00	0.08
333	000750	国海证券	10,800	54,324.00	0.08
334	002456	欧菲光	6,900	54,096.00	0.08
335	000031	大悦城	8,400	53,928.00	0.08
336	601598	中国外运	11,200	53,648.00	0.08
337	600675	中华企业	10,320	53,560.80	0.08
338	600699	均胜电子	2,500	53,400.00	0.08
339	000686	东北证券	6,000	52,860.00	0.07
340	000732	泰禾集团	3,200	52,800.00	0.07
341	601966	玲珑轮胎	3,100	52,700.00	0.07
342	600584	长电科技	4,100	52,685.00	0.07

343	000027	深圳能源	8,400	52,080.00	0.07
344	600808	马钢股份	15,200	51,832.00	0.07
345	000898	鞍钢股份	13,650	51,733.50	0.07
346	603000	人民网	2,900	51,707.00	0.07
347	002294	信立泰	2,300	51,474.00	0.07
348	002812	恩捷股份	1,100	51,425.00	0.07
349	000932	华菱钢铁	10,780	51,420.60	0.07
350	600549	厦门钨业	3,590	51,372.90	0.07
351	600008	首创股份	14,500	51,040.00	0.07
352	300251	光线传媒	7,500	51,000.00	0.07
353	300296	利亚德	6,500	50,895.00	0.07
354	002563	森马服饰	4,600	50,876.00	0.07
355	600820	隧道股份	8,000	50,480.00	0.07
356	600339	中油工程	11,900	50,218.00	0.07
357	002340	格林美	10,600	49,926.00	0.07
358	600160	巨化股份	6,990	49,698.90	0.07
359	000046	泛海控股	8,900	49,662.00	0.07
360	600392	盛和资源	4,490	49,659.40	0.07
361	600598	北大荒	4,600	49,358.00	0.07
362	000998	隆平高科	3,400	49,232.00	0.07
363	002773	康弘药业	1,495	49,215.40	0.07
364	000623	吉林敖东	3,000	49,170.00	0.07
365	000983	西山煤电	8,000	48,480.00	0.07
366	601179	中国西电	13,100	48,470.00	0.07
367	000883	湖北能源	11,100	48,174.00	0.07
368	600967	内蒙一机	4,300	48,160.00	0.07
369	000960	锡业股份	4,300	48,031.00	0.07
370	000729	燕京啤酒	7,200	47,808.00	0.07
371	600466	蓝光发展	7,660	47,645.20	0.07
372	300072	三聚环保	6,000	47,580.00	0.07
373	600885	宏发股份	1,940	47,142.00	0.07

374	603883	老百姓	800	46,784.00	0.07
375	601333	广深铁路	14,400	46,512.00	0.07
376	600863	内蒙华电	14,800	46,472.00	0.07
377	600201	生物股份	2,950	46,285.50	0.07
378	601958	金钼股份	6,900	46,230.00	0.07
379	600511	国药股份	2,000	45,940.00	0.06
380	000997	新大陆	2,700	45,603.00	0.06
381	600026	中远海能	7,000	45,430.00	0.06
382	600521	华海药业	3,220	45,402.00	0.06
383	000778	新兴铸管	10,200	45,288.00	0.06
384	600737	中粮糖业	5,200	45,136.00	0.06
385	600258	首旅酒店	2,500	44,950.00	0.06
386	002078	太阳纸业	6,600	44,946.00	0.06
387	002572	索菲亚	2,400	44,544.00	0.06
388	002217	合力泰	8,000	44,240.00	0.06
389	600373	中文传媒	3,500	43,960.00	0.06
390	601718	际华集团	11,200	43,792.00	0.06
391	002092	中泰化学	5,500	43,780.00	0.06
392	600486	扬农化工	800	43,760.00	0.06
393	600572	康恩贝	6,800	43,520.00	0.06
394	600446	金证股份	2,200	43,208.00	0.06
395	000060	中金岭南	9,150	42,913.50	0.06
396	600273	嘉化能源	3,700	42,772.00	0.06
397	603077	和邦生物	22,500	42,750.00	0.06
398	600879	航天电子	6,900	42,504.00	0.06
399	002152	广电运通	6,200	42,470.00	0.06
400	000826	启迪环境	3,600	42,444.00	0.06
401	002038	双鹭药业	1,800	42,408.00	0.06
402	600380	健康元	4,896	42,350.40	0.06
403	600649	城投控股	6,500	42,055.00	0.06
404	601880	大连港	19,700	41,961.00	0.06

405	600648	外高桥	2,000	41,960.00	0.06
406	000559	万向钱潮	7,000	41,860.00	0.06
407	000028	国药一致	1,000	41,830.00	0.06
408	601000	唐山港	15,120	41,580.00	0.06
409	600718	东软集团	3,200	41,024.00	0.06
410	000039	中集集团	3,840	41,011.20	0.06
411	000581	威孚高科	2,200	40,832.00	0.06
412	002085	万丰奥威	5,600	40,768.00	0.06
413	000513	丽珠集团	1,220	40,540.60	0.06
414	600782	新钢股份	8,100	40,500.00	0.06
415	000830	鲁西化工	3,700	40,256.00	0.06
416	600827	百联股份	4,100	40,221.00	0.06
417	000839	中信国安	10,000	40,200.00	0.06
418	600500	中化国际	5,300	39,591.00	0.06
419	600282	南钢股份	11,300	39,550.00	0.06
420	002583	海能达	4,700	39,433.00	0.06
421	600567	山鹰纸业	11,700	39,429.00	0.06
422	600643	爱建集团	4,100	39,278.00	0.06
423	601168	西部矿业	6,100	38,918.00	0.05
424	000738	航发控制	2,900	38,860.00	0.05
425	002174	游族网络	2,300	38,824.00	0.05
426	002074	国轩高科	2,900	38,019.00	0.05
427	002019	亿帆医药	3,100	37,975.00	0.05
428	600873	梅花生物	7,900	37,841.00	0.05
429	600037	歌华有线	3,600	36,900.00	0.05
430	600079	人福医药	3,500	36,750.00	0.05
431	600582	天地科技	10,600	36,570.00	0.05
432	600056	中国医药	2,700	36,423.00	0.05
433	002221	东华能源	4,200	36,162.00	0.05
434	000990	诚志股份	2,200	36,102.00	0.05
435	600777	新潮能源	17,300	35,984.00	0.05

436	600260	凯乐科技	1,800	35,964.00	0.05
437	002603	以岭药业	3,100	35,898.00	0.05
438	002424	贵州百灵	3,600	35,568.00	0.05
439	600348	阳泉煤业	6,100	35,441.00	0.05
440	000681	视觉中国	1,800	34,884.00	0.05
441	600835	上海机电	2,100	34,860.00	0.05
442	000937	冀中能源	9,000	34,740.00	0.05
443	000598	兴蓉环境	7,600	34,580.00	0.05
444	600754	锦江股份	1,400	34,496.00	0.05
445	600277	亿利洁能	7,000	34,090.00	0.05
446	002640	跨境通	4,000	33,320.00	0.05
447	600062	华润双鹤	2,640	33,290.40	0.05
448	600717	天津港	5,160	33,127.20	0.05
449	600787	中储股份	5,600	32,088.00	0.05
450	002745	木林森	2,700	31,644.00	0.04
451	600884	杉杉股份	2,900	30,885.00	0.04
452	600409	三友化工	5,300	29,998.00	0.04
453	000887	中鼎股份	3,100	29,729.00	0.04
454	600291	西水股份	2,800	28,168.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300782	卓胜微	471	51,301.32	0.07
2	600968	海油发展	12,915	45,848.25	0.06
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.05
4	601698	中国卫通	8,554	33,531.68	0.05

5	300594	朗进科技	631	27,833.41	0.04
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.04
7	603863	松炆资源	532	12,278.56	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	526,632.00	0.81
2	600989	宝丰能源	351,604.72	0.54
3	600519	贵州茅台	251,512.00	0.39
4	600010	包钢股份	231,284.00	0.36
5	300015	爱尔眼科	228,998.10	0.35
6	300059	东方财富	219,377.00	0.34
7	600703	三安光电	192,532.00	0.30
8	601600	中国铝业	159,704.00	0.25
9	300760	迈瑞医疗	158,738.00	0.24
10	600061	国投资本	153,879.00	0.24
11	600518	ST康美	153,860.00	0.24
12	300122	智飞生物	143,223.00	0.22
13	300750	宁德时代	133,701.00	0.21
14	300033	同花顺	124,104.00	0.19
15	000333	美的集团	123,204.00	0.19
16	601318	中国平安	120,605.00	0.19
17	002157	正邦科技	117,310.00	0.18
18	300003	乐普医疗	110,433.00	0.17
19	300142	沃森生物	99,135.00	0.15
20	601108	财通证券	98,190.00	0.15

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	926,338.16	1.43
2	000333	美的集团	654,584.00	1.01
3	601318	中国平安	646,358.00	1.00
4	600036	招商银行	529,357.00	0.82
5	600989	宝丰能源	369,826.44	0.57
6	601166	兴业银行	288,768.00	0.44
7	000858	五粮液	280,056.00	0.43
8	601988	中国银行	277,879.00	0.43
9	600000	浦发银行	250,825.00	0.39
10	600010	包钢股份	233,757.00	0.36
11	601398	工商银行	231,621.00	0.36
12	002415	海康威视	220,655.00	0.34
13	000002	万科A	216,167.00	0.33
14	600518	ST康美	214,439.00	0.33
15	600276	恒瑞医药	213,806.00	0.33
16	601288	农业银行	209,108.00	0.32
17	601668	中国建筑	189,901.00	0.29
18	600900	长江电力	184,483.00	0.28
19	601328	交通银行	183,229.00	0.28
20	600030	中信证券	171,439.00	0.26

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,226,684.59
卖出股票收入（成交）总额	21,563,762.11

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,001,800.00	4.23
	其中：政策性金融债	3,001,800.00	4.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,001,800.00	4.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108603	国开1804	30,000	3,001,800.00	4.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1909	IF1909	1	1,137,540.00	20,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					20,880.00
股指期货投资本期收益(元)					162,873.79
股指期货投资本期公允价值变动(元)					67,680.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2018年7月13日，宜宾五粮液股份有限公司（下称“五粮液”，股票代码：000858）从四川省纪委、监察委网站获悉宜宾市国有资产经营有限公司董事长张辉（其现任五粮液第五届董事会董事）正接受纪律审查和监察调查。张辉系宜宾市国资公司委派兼任五粮液董事。另2018年8月24日，五粮液从四川省纪委、监察委网站获悉五粮液监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法，目前正接受纪律审查和监察调查。余铭书于2012年7月从宜宾市国有资产经营有限公司调入本公司任职。本基金投研人员分析认为，上述事项不对五粮液生产经营和长远发展产生影响，五粮液将关注后续进展情况，并按有关规定及时履行相关程序和信息披露义务。五粮液作为白酒行业龙头之一，业绩稳健，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五粮液进行了投资。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	120,858.99
2	应收证券清算款	76,129.03
3	应收股利	-
4	应收利息	75,922.84
5	应收申购款	159,930.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	432,841.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.05	新发流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户均持有的基金份额	持有人结构				
			机构投资者		个人投资者		
			持有份额	占总	持有份额	占总份	

	户)			份额 比例		额比例
创金合信MSCI中国A股国际指数A	1,748	31,776.33	5,000,450.09	9.00%	50,544,575.62	91.00%
创金合信MSCI中国A股国际指数C	614	25,212.83	5,000,450.00	32.30%	10,480,224.66	67.70%
合计	2,308	30,773.70	10,000,900.09	14.08%	61,024,800.28	85.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	140,662.48	0.25%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	122,819.72	0.79%
	合计	263,482.20	0.37%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	0~10
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0

	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	0
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	14.08%	10,000,900.09	14.08%	36月
基金管理人高级管理人员	14,678.78	0.02%	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	10,015,578.87	14.10%	10,000,900.09	14.08%	36月

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
--	-------------------	-------------------

基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	55,960,583.31	12,417,879.67
本报告期期初基金份额总额	63,735,597.38	18,571,394.88
本报告期基金总申购份额	8,715,194.44	3,282,739.13
减:本报告期基金总赎回份额	16,905,766.11	6,373,459.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,545,025.71	15,480,674.66

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2019年6月12日起,张雪松先生不再担任创金合信基金管理有限公司副总经理。本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	30,078,187.11	99.05%	21,750.67	99.56%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	288,068.00	0.95%	95.42	0.44%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	6,007,791.97	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2018年第4季度报告	公司官网、中国证券报	2019-01-19
2	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2019-02-26
3	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金（2019年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2019-03-22

4	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	公司官网、中国证券报	2019-03-22
5	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与中投证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2019-03-28
6	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2018年年度报告	公司官网	2019-03-29
7	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2019-03-29
8	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2019-04-04
9	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2019年第一季度报告	公司官网、中国证券报	2019-04-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2019年半年度报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦15楼

12.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十七日