
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

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	12
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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	72
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	72
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	72
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.12 投资组合报告附注	72
§8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75

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	75
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	76
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 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	60,218,981.13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	16,940,984.67份	43,277,996.46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	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	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	-11,934,313.50	-4,593,992.84
本期利润	-12,387,285.87	-5,229,158.23
加权平均基金份额本期利润	-0.1291	-0.1924
本期加权平均净值利润率	-13.51%	-20.38%
本期基金份额净值增长率	-12.67%	-12.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-3,188,105.61	-8,143,948.03
期末可供分配基金份额利润	-0.1882	-0.1882
期末基金资产净值	14,435,884.10	36,878,044.94
期末基金份额净值	0.8521	0.8521
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.79%	-14.79%

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
过去一 个月	-9.04%	1.90%	-10.64%	1.87%	1.60%	0.03%
过去三 个月	-12.94%	1.39%	-16.66%	1.38%	3.72%	0.01%
过去六 个月	-12.67%	1.43%	-19.09%	1.43%	6.42%	0.00%
过去一 年	-9.85%	1.17%	-23.66%	1.21%	13.81%	-0.04%
自基金 合同生 效起至 今	-14.79%	1.10%	-33.28%	1.13%	18.49%	-0.03%

创金合信中证1000增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一 个月	-9.06%	1.90%	-10.64%	1.87%	1.58%	0.03%
过去三 个月	-12.89%	1.39%	-16.66%	1.38%	3.77%	0.01%
过去六 个月	-12.64%	1.43%	-19.09%	1.43%	6.45%	0.00%
过去一 年	-9.79%	1.17%	-23.66%	1.21%	13.87%	-0.04%
自基金 合同生 效起至	-14.79%	1.10%	-33.28%	1.13%	18.49%	-0.03%

今						
---	--	--	--	--	--	--

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月2日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

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

报告期内，本公司共发行11只公募基金。截至2018年6月30日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约147.33亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庞世恩	本基金基金经理	2016-12-22	-	6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，现任基金经理。
程志田	本基金基金经理、量	2016-12-22	-	11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

	化投资 部总监			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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向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52次，该基金为量化选

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年上半年，我们严格依据量化选股模型进行投资，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0.8521元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.67%，同期业绩比较基准收益率为-19.09%；截至报告期末创金合信中证1000增强C基金份额净值为0.8521元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.64%，同期业绩比较基准收益率为-19.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年，在去杠杆的大环境下，市场有所动荡，主流的指数均有所调整。边际上看，宏观经济仍处于复苏阶段，经济增速没有太大的风险；随着去杠杆取得一定成效，流动性边际上有所改善，对股市有一定的利好；估值的角度来看，以中证500和中证1000为代表的中小盘风格指数的估值处于历史底部位置，沪深300为代表的大盘蓝筹风格指数也处于估值偏低的位置，股票市场整体具备估值吸引力。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-创金合信基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30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半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	805,174.32	3,656,874.22

结算备付金		1,224,543.40	3,011,126.34
存出保证金		133,878.15	110,107.64
交易性金融资产	6.4.7.2	51,286,464.41	207,208,031.86
其中：股票投资		48,707,756.81	196,110,171.06
基金投资		-	-
债券投资		2,578,707.60	11,097,860.80
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		313,051.33	1,993,099.38
应收利息	6.4.7.5	66,682.30	65,650.24
应收股利		-	-
应收申购款		41,063.39	615,783.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,870,857.30	216,660,673.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,000,000.00	-
应付证券清算款		136,095.92	-
应付赎回款		24,233.15	20,455.61
应付管理人报酬		35,204.64	144,506.50
应付托管费		6,600.85	27,094.96
应付销售服务费		6,413.65	1,613.21
应付交易费用	6.4.7.7	259,532.57	1,014,705.99
应交税费		-	-

应付利息		-537.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,384.87	145,000.62
负债合计		2,556,928.26	1,353,376.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,218,981.13	220,669,622.69
未分配利润	6.4.7.1 0	-8,905,052.09	-5,362,326.00
所有者权益合计		51,313,929.04	215,307,296.69
负债和所有者权益总计		53,870,857.30	216,660,673.58

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额60,218,981.13份，其中下属A类基金份额16,940,984.67份，C类基金份额43,277,996.46份。下属A类基金份额净值0.8521元，C类基金份额净值0.8521元。

6.2 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06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-13,801,147.12	-9,837,384.45
1. 利息收入		137,234.76	52,194.55
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	36,556.62	52,194.55
债券利息收入		99,587.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,090.74	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,933,323.77	-9,438,914.99
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-13,281,531.89	-10,498,476.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	26,975.89	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	321,232.23	1,059,561.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-1,088,137.76	-453,606.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	83,079.65	2,942.13
减：二、费用		3,815,296.98	2,758,232.44
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	466,193.88	766,741.96
2. 托管费	6.4.10. 2.2	87,411.30	143,764.16
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	25,159.75	5,312.94
4. 交易费用	6.4.7.1 8	3,116,996.10	1,752,479.29
5. 利息支出		17,127.16	-
其中：卖出回购金融资产支出		17,127.16	-

6. 税金及附加		0.67	-
7. 其他费用	6.4.7.1 9	102,408.12	89,934.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,616,444.10	-12,595,616.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,616,444.10	-12,595,616.89

6.3 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06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-17,616,444.10	-17,616,444.10
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)	-160,450,641.56	14,073,718.01	-146,376,923.55
其中：1. 基金申购款	65,042,060.32	-2,997,428.89	62,044,631.43
2. 基金赎回款	-225,492,701.88	17,071,146.90	-208,421,554.98
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）	60,218,981.13	-8,905,052.09	51,313,929.04
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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）	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）	-	-12,595,616.89	-12,595,616.89
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）	201,694,534.75	1,104,999.53	202,799,534.28
其中：1. 基金申购款	202,703,172.14	1,052,059.76	203,755,231.90
2. 基金赎回款	-1,008,637.39	52,939.77	-955,697.62
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）	211,823,366.71	-11,605,624.91	200,217,741.80

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]第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,已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”)。

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、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可将其纳入投资范围。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%。

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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	805,174.32
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	805,174.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	51,101,452.01	48,707,756.81	-2,393,695.20	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,581,211.23	2,578,707.60	-2,503.63
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,581,211.23	2,578,707.60	-2,503.63
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	53,682,663.24	51,286,464.41	-2,396,198.83	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	148.06
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	551.00
应收债券利息	65,922.94
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	60.30
合计	66,682.30

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	259,532.57

银行间市场应付交易费用	-
合计	259,532.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43.52
预提费用	89,341.35
合计	89,384.87

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 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06月30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	11,023,486.67	11,023,486.67
本期赎回(以“-”号填列)	-204,498,196.76	-204,498,196.76
本期末	16,940,984.67	16,940,984.67

6.4.7.9.2 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06月30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	54,018,573.65	54,018,573.65
本期赎回(以“-”号填列)	-20,994,505.12	-20,994,505.12

本期末	43,277,996.46	43,277,996.46
-----	---------------	---------------

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	-11,934,313.50	-452,972.37	-12,387,285.87
本期基金份额交易产生的变动数	14,408,454.29	583,884.04	14,992,338.33
其中:基金申购款	-734,265.46	37,703.49	-696,561.97
基金赎回款	15,142,719.75	546,180.55	15,688,900.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,188,105.61	683,005.04	-2,505,100.57

6.4.7.10.2 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	-4,593,992.84	-635,165.39	-5,229,158.23
本期基金份额交易产生的变动数	-3,270,871.23	2,352,250.91	-918,620.32
其中:基金申购款	-5,372,085.04	3,071,218.12	-2,300,866.92
基金赎回款	2,101,213.81	-718,967.21	1,382,246.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,143,948.03	1,743,996.51	-6,399,951.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	10,932.69
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	24,492.27
其他	1,131.66
合计	36,556.62

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	1,579,067,538.20
减：卖出股票成本总额	1,592,349,070.09
买卖股票差价收入	-13,281,531.89

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 2018年01月01日至2018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	26,975.89
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	26,975.89

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
----	----

	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,954,492.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,777,791.47
减：应收利息总额	149,725.09
买卖债券差价收入	26,975.89

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	321,232.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	321,232.23

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,088,137.76
——股票投资	-1,107,873.33
——债券投资	19,735.57
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,088,137.76

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	80,850.68
转换费收入	2,228.97
合计	83,079.65

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	3,116,996.10
银行间市场交易费用	-
合计	3,116,996.10

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	3,066.77
指数使用费	20,000.00
合计	102,408.12

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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	3,023,656,411.28	100.00%	-	-

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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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	12,375,705.65	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	70,600,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占 当	期末应付佣金余额	占 期

		期 佣 金 总 量 的 比 例		未 应 付 佣 金 总 额 的 比 例
第一创业 证券股份 有限公司	1,269,459.84	10 0. 00 %	259,532.57	10 0. 00 %
关联方名 称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	466,193.88	766,741.96
其中：支付销售机构的客户维护费	38,470.49	2,869.35

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,411.30	143,764.16

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C	合计
创金合信基金	0.00	18,974.45	18,974.45
合计	-	18,974.45	18,974.45
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06月30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
创金合信基金	-	4,273.25	4,273.25
合计	-	4,273.25	4,273.25

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。

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

创金合信中证1000增强A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30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	-	-
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	5,000,166.70	5,000,166.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.52%	2.44%

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
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	11.55%	75.59%

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基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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
中国农业银行股份有限公司	805,174.32	10,932.69	8,347,583.67	38,779.03

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。

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

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。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000796	凯撒旅游	2018-01-19	重大事项停牌	12.90	2018-07-19	11.61	77,200	991,861.00	995,880.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	21,900	245,826.00	236,520.00	-
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	35,000	195,162.81	168,350.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项停牌	18.08	-	-	9,100	159,053.00	164,528.00	-
002171	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	23,200	160,936.99	157,296.00	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项停牌	59.72	2018-07-16	65.69	2,000	117,351.67	119,440.00	-
000603	盛达矿业	2018-06-11	重大事项停牌	10.83	2018-08-21	9.75	10,100	113,477.00	109,383.00	-
603636	南威软件	2018-05-29	重大事项停牌	10.00	-	-	10,000	103,232.46	100,000.00	-
002436	兴森科技	2018-06-14	重大事项停牌	3.99	-	-	18,500	79,915.00	73,815.00	-
002102	冠福股份	2018-06-01	重大事项停牌	4.07	-	-	13,600	54,536.00	55,352.00	-
002502	骅威文化	2018-06-05	重大事项停牌	5.82	-	-	8,000	54,976.15	46,560.00	-
002445	中南文化	2018-06-13	重大事项停牌	8.44	-	-	3,700	34,023.00	31,228.00	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大事项停牌	6.05	2018-07-20	5.45	4,700	28,141.00	28,435.00	-
600052	浙江广厦	2018-04-02	重大事项停牌	3.73	2018-07-30	3.90	5,600	20,733.37	20,888.00	-

300111	向日葵	2018-06-04	重大事项停牌	2.74	-	-	5,900	17,044.93	16,166.00	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大事项停牌	30.48	-	-	500	14,182.00	15,240.00	-
300187	永清环保	2018-04-09	重大事项停牌	9.32	-	-	1,500	14,475.00	13,980.00	-
002226	江南化工	2018-05-02	重大事项停牌	5.42	-	-	2,400	13,071.00	13,008.00	-
600189	吉林森工	2018-03-28	重大事项停牌	7.51	2018-07-02	6.76	1,400	10,466.86	10,514.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,000,000.00元，于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	2,578,707.60	10,575,620.00
合计	2,578,707.60	10,575,620.00

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

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	490,240.80
AAA以下	0.00	32,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	522,240.80

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2018年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有2,000,000.00元将在1个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为50,094,030.00元，超过经确认的当日净赎回金额。于2018年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为4.63%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	805,174.32	-	-	-	805,174.32
结算备付金	1,224,543.40	-	-	-	1,224,543.40
存出保证金	133,878.15	-	-	-	133,878.15

交易性金融资产	2,578,707.60	-	-	48,707,756.81	51,286,464.41
应收证券清算款	-	-	-	313,051.33	313,051.33
应收利息	-	-	-	66,682.30	66,682.30
应收申购款	-	-	-	41,063.39	41,063.39
资产总计	4,742,303.47	-	-	49,128,553.83	53,870,857.30
负债					
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	136,095.92	136,095.92
应付赎回款	-	-	-	24,233.15	24,233.15
应付管理人报酬	-	-	-	35,204.64	35,204.64
应付托管费	-	-	-	6,600.85	6,600.85
应付销售服务费	-	-	-	6,413.65	6,413.65
应付交易费用	-	-	-	259,532.57	259,532.57
应付利息	-	-	-	-537.39	-537.39
其他负债	-	-	-	89,384.87	89,384.87
负债总计	2,000,000.00	-	-	556,928.26	2,556,928.26
利率敏感度缺	2,742,303.47	-	-	48,571,625.57	51,313,929.04

口					
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	-	-	-	145,000.62	145,000.62

债					
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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25个基点	-	-21,611.13
	市场利率下降25个基点	-	21,707.50

于2018年6月30日本基金持有的交易性债券资产公允价值占基金资产净值的比例为5.03%(2017年12月31日:5.20%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日:同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	48,707,756.81	94.92	196,110,171.06	91.08
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	48,707,756.81	94.92	196,110,171.06	91.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	2,610,336.31	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-2,610,336.31	-
	比较基准上涨5%资产净值变动	-	8,892,532.64
	比较基准下降5%资产净值变动	-	-8,892,532.64

	值变动		
--	-----	--	--

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为46,331,173.81元，第二层次的余额为4,955,290.60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，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	48,707,756.81	90.42
	其中：股票	48,707,756.81	90.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,578,707.60	4.79
	其中：债券	2,578,707.60	4.79
	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	2,029,717.72	3.77
8	其他各项资产	554,675.17	1.03
9	合计	53,870,857.30	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	164,662.00	0.32
B	采矿业	576,938.00	1.12
C	制造业	26,650,001.26	51.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,150,393.00	2.24
E	建筑业	1,068,465.00	2.08
F	批发和零售业	1,517,444.80	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,278,648.00	2.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	4,419,856.00	8.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,404,270.80	2.74
L	租赁和商务服务业	1,482,174.00	2.89
M	科学研究和技术服务业	450,180.00	0.88
N	水利、环境和公共设施 管理业	421,520.00	0.82
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	475,482.00	0.93
S	综合	393,300.45	0.77
	合计	41,453,335.31	80.78

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	75,619.00	0.15
B	采矿业	275,176.60	0.54
C	制造业	4,106,828.50	8.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	228,014.00	0.44
E	建筑业	303,168.00	0.59
F	批发和零售业	443,889.00	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	201,239.00	0.39
H	住宿和餐饮业	10,968.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	547,077.00	1.07
J	金融业	152,505.00	0.30
K	房地产业	274,021.00	0.53
L	租赁和商务服务业	90,800.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	36,865.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	127,706.60	0.25
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	229,251.80	0.45
S	综合	151,293.00	0.29
	合计	7,254,421.50	14.14

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	600734	实达集团	210,800	1,443,980.00	2.81
2	000796	凯撒旅游	77,200	995,880.00	1.94
3	600567	山鹰纸业	137,700	531,522.00	1.04
4	600486	扬农化工	8,000	447,440.00	0.87
5	000040	东旭蓝天	41,800	422,180.00	0.82
6	002383	合众思壮	25,300	418,715.00	0.82
7	300463	迈克生物	13,300	331,569.00	0.65
8	300098	高新兴	39,700	316,806.00	0.62
9	000818	航锦科技	26,200	304,706.00	0.59
10	600185	格力地产	52,300	283,989.00	0.55
11	002501	利源精制	45,500	282,100.00	0.55
12	002597	金禾实业	13,900	281,892.00	0.55
13	002680	ST长生	12,500	278,625.00	0.54
14	002402	和而泰	32,400	268,920.00	0.52
15	000869	张裕A	6,700	267,062.00	0.52
16	300367	东方网力	21,300	266,250.00	0.52
17	300294	博雅生物	8,500	263,415.00	0.51
18	300285	国瓷材料	13,000	259,220.00	0.51
19	300482	万孚生物	3,700	259,000.00	0.50
20	002095	生意宝	7,200	258,408.00	0.50
21	002449	国星光电	24,160	257,062.40	0.50
22	002421	达实智能	62,900	254,745.00	0.50
23	600337	美克家居	43,030	252,155.80	0.49
24	002185	华天科技	44,500	250,980.00	0.49
25	000088	盐田港	37,400	246,466.00	0.48
26	000591	太阳能	67,300	246,318.00	0.48
27	002550	千红制药	44,000	245,960.00	0.48
28	002327	富安娜	22,600	244,984.00	0.48
29	002156	通富微电	22,400	242,592.00	0.47
30	002258	利尔化学	12,500	242,000.00	0.47
31	000875	吉电股份	84,600	239,418.00	0.47

32	002091	江苏国泰	37,700	239,395.00	0.47
33	300118	东方日升	21,900	236,520.00	0.46
34	300020	银江股份	24,800	235,848.00	0.46
35	601929	吉视传媒	103,400	232,650.00	0.45
36	600420	现代制药	22,300	231,920.00	0.45
37	600114	东睦股份	22,900	223,733.00	0.44
38	002429	兆驰股份	90,200	223,696.00	0.44
39	300178	腾邦国际	15,700	220,742.00	0.43
40	002626	金达威	12,700	220,345.00	0.43
41	600803	新奥股份	18,900	218,106.00	0.43
42	600491	龙元建设	31,200	218,088.00	0.43
43	600708	光明地产	50,340	216,462.00	0.42
44	600285	羚锐制药	24,187	215,506.17	0.42
45	300149	量子生物	12,900	212,592.00	0.41
46	600269	赣粤高速	51,000	208,590.00	0.41
47	002061	浙江交科	19,900	208,353.00	0.41
48	601369	陕鼓动力	32,400	207,360.00	0.40
49	002341	新纶科技	15,600	207,324.00	0.40
50	002139	拓邦股份	36,400	207,116.00	0.40
51	002043	兔宝宝	27,000	206,820.00	0.40
52	300298	三诺生物	9,900	204,732.00	0.40
53	601799	星宇股份	3,400	203,626.00	0.40
54	002649	博彦科技	21,900	199,728.00	0.39
55	000915	山大华特	9,600	193,056.00	0.38
56	002279	久其软件	19,000	188,290.00	0.37
57	002614	奥佳华	9,000	186,210.00	0.36
58	000767	漳泽电力	72,800	185,640.00	0.36
59	002318	久立特材	30,759	185,169.18	0.36
60	600997	开滦股份	34,700	181,828.00	0.35
61	002467	二六三	33,400	181,028.00	0.35
62	000828	东莞控股	22,500	179,550.00	0.35

63	300476	胜宏科技	11,500	177,100.00	0.35
64	300398	飞凯材料	9,000	176,040.00	0.34
65	002557	洽洽食品	11,500	175,375.00	0.34
66	300284	苏交科	22,000	174,460.00	0.34
67	002484	江海股份	26,600	173,964.00	0.34
68	300292	吴通控股	47,400	173,484.00	0.34
69	002206	海利得	34,600	172,654.00	0.34
70	002756	永兴特钢	9,900	171,963.00	0.34
71	300438	鹏辉能源	8,900	171,859.00	0.33
72	600330	天通股份	25,080	171,798.00	0.33
73	600200	江苏吴中	22,700	171,158.00	0.33
74	002025	航天电器	7,400	170,940.00	0.33
75	600676	交运股份	34,300	170,471.00	0.33
76	600602	云赛智联	29,300	169,940.00	0.33
77	300212	易华录	7,180	169,807.00	0.33
78	600331	宏达股份	65,500	169,645.00	0.33
79	002126	银轮股份	18,800	169,576.00	0.33
80	002585	双星新材	31,700	169,278.00	0.33
81	002582	好想你	15,500	168,485.00	0.33
82	300409	道氏技术	4,200	168,462.00	0.33
83	300008	天海防务	35,000	168,350.00	0.33
84	600677	航天通信	20,500	165,435.00	0.32
85	000666	经纬纺机	9,100	164,528.00	0.32
86	002283	天润曲轴	41,200	163,152.00	0.32
87	300184	力源信息	14,800	158,656.00	0.31
88	300183	东软载波	10,300	158,311.00	0.31
89	600590	泰豪科技	24,410	157,444.50	0.31
90	002171	楚江新材	23,200	157,296.00	0.31
91	000036	华联控股	26,000	154,440.00	0.30
92	300485	赛升药业	10,700	153,973.00	0.30
93	002224	三力士	25,800	153,768.00	0.30

94	300231	银信科技	20,200	153,520.00	0.30
95	002255	海陆重工	29,200	151,256.00	0.29
96	603989	艾华集团	6,710	150,773.70	0.29
97	002543	万和电气	7,800	150,696.00	0.29
98	002372	伟星新材	8,500	150,365.00	0.29
99	601566	九牧王	10,100	148,975.00	0.29
100	601599	鹿港文化	36,500	148,555.00	0.29
101	002335	科华恒盛	8,200	148,010.00	0.29
102	002446	盛路通信	21,500	147,490.00	0.29
103	300021	大禹节水	28,450	147,371.00	0.29
104	000631	顺发恒业	42,800	146,804.00	0.29
105	600995	文山电力	19,500	146,445.00	0.29
106	300142	沃森生物	7,300	145,854.00	0.28
107	002298	中电兴发	20,600	145,436.00	0.28
108	000965	天保基建	32,890	145,373.80	0.28
109	600624	复旦复华	27,983	144,112.45	0.28
110	600459	贵研铂业	13,260	143,208.00	0.28
111	002060	粤水电	48,800	142,984.00	0.28
112	000687	华讯方舟	15,500	142,755.00	0.28
113	002430	杭氧股份	9,900	141,867.00	0.28
114	002247	帝龙文化	17,100	140,220.00	0.27
115	600845	宝信软件	5,300	139,655.00	0.27
116	002303	美盈森	26,300	138,864.00	0.27
117	002331	皖通科技	18,700	138,380.00	0.27
118	300309	吉艾科技	6,800	137,904.00	0.27
119	002717	岭南股份	14,000	137,340.00	0.27
120	002393	力生制药	5,600	137,088.00	0.27
121	000070	特发信息	18,900	137,025.00	0.27
122	002314	南山控股	34,000	137,020.00	0.27
123	300194	福安药业	29,100	136,770.00	0.27
124	002737	葵花药业	6,300	136,269.00	0.27

125	600973	宝胜股份	37,280	136,072.00	0.27
126	601100	恒立液压	6,500	135,720.00	0.26
127	002516	旷达科技	37,700	134,212.00	0.26
128	600686	金龙汽车	10,600	132,394.00	0.26
129	002406	远东传动	24,100	132,309.00	0.26
130	300006	莱美药业	31,600	131,456.00	0.26
131	600123	兰花科创	18,700	130,339.00	0.25
132	002141	贤丰控股	30,300	126,957.00	0.25
133	300050	世纪鼎利	21,100	126,600.00	0.25
134	000404	长虹华意	29,100	126,003.00	0.25
135	600650	锦江投资	11,900	124,712.00	0.24
136	002349	精华制药	21,300	124,392.00	0.24
137	002519	银河电子	27,800	123,432.00	0.24
138	600775	南京熊猫	21,800	123,388.00	0.24
139	000901	航天科技	12,200	122,244.00	0.24
140	002158	汉钟精机	13,600	122,128.00	0.24
141	002339	积成电子	16,600	122,010.00	0.24
142	600173	卧龙地产	28,300	121,690.00	0.24
143	300307	慈星股份	19,800	121,374.00	0.24
144	300316	晶盛机电	9,100	120,939.00	0.24
145	300295	三六五网	9,000	119,880.00	0.23
146	603618	杭电股份	19,400	119,504.00	0.23
147	603939	益丰药房	2,000	119,440.00	0.23
148	600475	华光股份	11,100	118,659.00	0.23
149	300381	溢多利	13,600	118,456.00	0.23
150	300011	鼎汉技术	18,300	116,754.00	0.23
151	000892	欢瑞世纪	24,700	116,337.00	0.23
152	600255	梦舟股份	51,800	116,032.00	0.23
153	600592	龙溪股份	18,800	115,620.00	0.23
154	300172	中电环保	20,500	115,415.00	0.22
155	600508	上海能源	10,800	115,344.00	0.22

156	002203	海亮股份	14,200	115,020.00	0.22
157	300052	中青宝	10,700	114,062.00	0.22
158	000789	万年青	10,300	112,682.00	0.22
159	600830	香溢融通	20,700	112,194.00	0.22
160	600136	当代明诚	9,200	111,320.00	0.22
161	600278	东方创业	14,100	111,249.00	0.22
162	000030	富奥股份	14,900	110,558.00	0.22
163	300232	洲明科技	11,120	109,865.60	0.21
164	300213	佳讯飞鸿	17,400	109,620.00	0.21
165	000603	盛达矿业	10,100	109,383.00	0.21
166	300205	天喻信息	14,400	109,296.00	0.21
167	603116	红蜻蜓	8,300	108,896.00	0.21
168	300007	汉威科技	8,600	108,704.00	0.21
169	002401	中远海科	10,800	108,324.00	0.21
170	000058	深赛格	21,100	108,032.00	0.21
171	601908	京运通	23,500	107,630.00	0.21
172	600629	华建集团	9,000	107,370.00	0.21
173	300440	运达科技	16,400	107,092.00	0.21
174	600132	重庆啤酒	3,800	105,222.00	0.21
175	002023	海特高新	8,300	104,082.00	0.20
176	002148	北纬科技	17,700	102,660.00	0.20
177	300252	金信诺	11,260	102,128.20	0.20
178	000407	胜利股份	24,600	101,598.00	0.20
179	601126	四方股份	19,900	101,291.00	0.20
180	601388	怡球资源	39,900	100,548.00	0.20
181	603636	南威软件	10,000	100,000.00	0.19
182	300432	富临精工	11,400	99,864.00	0.19
183	603898	好莱客	3,800	99,712.00	0.19
184	002783	凯龙股份	12,100	99,583.00	0.19
185	600386	北巴传媒	25,500	99,195.00	0.19
186	600662	强生控股	24,700	98,553.00	0.19

187	002287	奇正藏药	3,400	97,886.00	0.19
188	000657	中钨高新	9,600	97,824.00	0.19
189	002232	启明信息	12,500	97,625.00	0.19
190	600626	申达股份	18,900	97,335.00	0.19
191	002231	奥维通信	16,600	96,612.00	0.19
192	300419	浩丰科技	14,800	95,756.00	0.19
193	600456	宝钛股份	6,600	95,700.00	0.19
194	300511	雪榕生物	10,700	95,016.00	0.19
195	603227	雪峰科技	24,400	94,672.00	0.18
196	300303	聚飞光电	34,500	94,530.00	0.18
197	600480	凌云股份	9,800	94,276.00	0.18
198	000902	新洋丰	10,200	93,840.00	0.18
199	300439	美康生物	4,300	92,880.00	0.18
200	002574	明牌珠宝	16,500	91,410.00	0.18
201	000821	京山轻机	9,900	91,179.00	0.18
202	300388	国祯环保	4,700	90,569.00	0.18
203	002166	莱茵生物	12,200	89,304.00	0.17
204	002443	金洲管道	13,000	87,880.00	0.17
205	002518	科士达	8,700	86,739.00	0.17
206	002262	恩华药业	4,300	86,043.00	0.17
207	002540	亚太科技	16,500	85,800.00	0.17
208	002507	涪陵榨菜	3,200	82,176.00	0.16
209	601222	林洋能源	16,100	80,178.00	0.16
210	600758	红阳能源	18,300	79,422.00	0.15
211	000700	模塑科技	21,500	78,905.00	0.15
212	600814	杭州解百	12,700	78,740.00	0.15
213	600082	海泰发展	17,000	78,030.00	0.15
214	000676	智度股份	6,300	77,994.00	0.15
215	000546	金圆股份	5,800	77,546.00	0.15
216	000561	烽火电子	12,900	76,368.00	0.15
217	002511	中顺洁柔	8,000	75,360.00	0.15

218	300378	鼎捷软件	6,000	75,300.00	0.15
219	002293	罗莱生活	5,000	75,150.00	0.15
220	600966	博汇纸业	17,300	74,563.00	0.15
221	603368	柳药股份	2,200	74,316.00	0.14
222	002436	兴森科技	18,500	73,815.00	0.14
223	600310	桂东电力	18,600	73,470.00	0.14
224	601137	博威合金	8,600	69,488.00	0.14
225	300467	迅游科技	2,100	67,410.00	0.13
226	300100	双林股份	6,100	66,795.00	0.13
227	000059	华锦股份	9,600	66,144.00	0.13
228	002215	诺普信	9,500	66,120.00	0.13
229	601588	北辰实业	18,200	64,064.00	0.12
230	300447	全信股份	4,900	63,406.00	0.12
231	002104	恒宝股份	9,200	62,652.00	0.12
232	300528	幸福蓝海	5,500	61,875.00	0.12
233	002151	北斗星通	2,400	61,680.00	0.12
234	000722	湖南发展	10,100	61,408.00	0.12
235	600279	重庆港九	13,800	61,272.00	0.12
236	300349	金卡智能	3,100	59,644.00	0.12
237	000533	万家乐	15,900	58,671.00	0.11
238	002631	德尔未来	7,900	58,460.00	0.11
239	000555	神州信息	4,400	58,432.00	0.11
240	002510	天汽模	12,100	57,233.00	0.11
241	300310	宜通世纪	8,900	56,782.00	0.11
242	600063	皖维高新	20,971	56,411.99	0.11
243	300160	秀强股份	13,300	55,860.00	0.11
244	002102	冠福股份	13,600	55,352.00	0.11
245	300185	通裕重工	30,500	55,205.00	0.11
246	001896	豫能控股	15,400	54,516.00	0.11
247	600055	万东医疗	4,900	54,096.00	0.11
248	300424	航新科技	2,700	52,434.00	0.10

249	002245	澳洋顺昌	8,100	52,407.00	0.10
250	600106	重庆路桥	17,100	51,300.00	0.10
251	600054	黄山旅游	4,400	51,260.00	0.10
252	603979	金诚信	5,800	49,474.00	0.10
253	603108	润达医疗	4,400	49,368.00	0.10
254	300045	华力创通	5,300	49,131.00	0.10
255	300096	易联众	5,800	48,836.00	0.10
256	002685	华东重机	5,900	48,557.00	0.09
257	000550	江铃汽车	4,000	48,440.00	0.09
258	000795	英洛华	10,200	48,042.00	0.09
259	002253	川大智胜	3,300	47,883.00	0.09
260	600103	青山纸业	16,000	47,840.00	0.09
261	002182	云海金属	7,800	47,502.00	0.09
262	300148	天舟文化	10,500	47,250.00	0.09
263	601101	昊华能源	7,200	46,800.00	0.09
264	002502	骅威文化	8,000	46,560.00	0.09
265	600684	珠江实业	8,200	46,248.00	0.09
266	300191	潜能恒信	2,600	46,176.00	0.09
267	600846	同济科技	6,100	45,933.00	0.09
268	603003	龙宇燃油	5,500	45,705.00	0.09
269	600548	深高速	5,800	45,530.00	0.09
270	002521	齐峰新材	6,976	45,483.52	0.09
271	000043	中航善达	6,400	45,376.00	0.09
272	300063	天龙集团	13,100	45,326.00	0.09
273	300048	合康新能	14,700	45,129.00	0.09
274	002124	天邦股份	10,400	44,928.00	0.09
275	000837	秦川机床	8,900	44,055.00	0.09
276	002638	勤上股份	13,300	43,890.00	0.09
277	000838	财信发展	11,600	42,804.00	0.08
278	300276	三丰智能	3,500	42,630.00	0.08
279	600963	岳阳林纸	8,200	42,476.00	0.08

280	600744	华银电力	15,400	41,580.00	0.08
281	000925	众合科技	6,700	41,540.00	0.08
282	002658	雪迪龙	5,300	41,393.00	0.08
283	600467	好当家	17,800	41,296.00	0.08
284	002535	林州重机	10,700	40,232.00	0.08
285	300328	宜安科技	5,300	39,644.00	0.08
286	002662	京威股份	9,000	37,800.00	0.07
287	002584	西陇科学	4,800	35,712.00	0.07
288	600190	锦州港	11,100	34,743.00	0.07
289	600261	阳光照明	9,200	34,592.00	0.07
290	002343	慈文传媒	1,800	33,786.00	0.07
291	000920	南方汇通	5,400	33,318.00	0.06
292	603609	禾丰牧业	3,500	33,040.00	0.06
293	300034	钢研高纳	3,500	32,760.00	0.06
294	002177	御银股份	8,600	32,422.00	0.06
295	002534	杭锅股份	4,700	31,819.00	0.06
296	002445	中南文化	3,700	31,228.00	0.06
297	601011	宝泰隆	5,500	31,185.00	0.06
298	002135	东南网架	6,100	30,927.00	0.06
299	300145	中金环境	3,900	30,537.00	0.06
300	002590	万安科技	3,600	29,520.00	0.06
301	002695	煌上煌	2,200	29,436.00	0.06
302	300386	飞天诚信	2,500	29,425.00	0.06
303	002089	新海宜	4,700	28,435.00	0.06
304	002746	仙坛股份	2,500	28,350.00	0.06
305	300248	新开普	4,500	27,540.00	0.05
306	603508	思维列控	800	27,176.00	0.05
307	000607	华媒控股	6,600	27,126.00	0.05
308	300171	东富龙	4,000	27,040.00	0.05
309	300262	巴安水务	5,200	26,936.00	0.05
310	600828	茂业商业	4,600	23,460.00	0.05

311	002724	海洋王	4,000	22,360.00	0.04
312	300222	科大智能	1,200	22,248.00	0.04
313	600782	新钢股份	3,000	16,740.00	0.03
314	600745	闻泰科技	500	15,240.00	0.03
315	002117	东港股份	1,000	14,830.00	0.03
316	002226	江南化工	2,400	13,008.00	0.03
317	002425	凯撒文化	2,500	11,875.00	0.02
318	600096	云天化	1,800	9,072.00	0.02
319	000429	粤高速 A	700	5,054.00	0.01
320	000889	茂业通信	300	3,828.00	0.01
321	600693	东百集团	500	2,995.00	0.01

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	002374	丽鹏股份	11,600	56,492.00	0.11
2	300427	红相股份	3,500	50,400.00	0.10
3	300190	维尔利	9,000	49,050.00	0.10
4	000997	新大陆	3,100	48,825.00	0.10
5	600805	悦达投资	9,500	48,450.00	0.09
6	000547	航天发展	6,200	48,422.00	0.09
7	002261	拓维信息	10,500	48,300.00	0.09
8	300346	南大光电	3,700	48,211.00	0.09
9	002422	科伦药业	1,500	48,150.00	0.09
10	000551	创元科技	8,300	48,057.00	0.09
11	002487	大金重工	13,100	47,946.00	0.09
12	300150	世纪瑞尔	9,900	47,817.00	0.09
13	002663	普邦股份	16,100	47,817.00	0.09
14	002671	龙泉股份	10,700	47,722.00	0.09
15	000758	中色股份	10,600	47,700.00	0.09

16	300351	永贵电器	3,800	47,614.00	0.09
17	000719	中原传媒	7,100	47,499.00	0.09
18	002078	太阳纸业	4,900	47,481.00	0.09
19	600603	广汇物流	11,800	47,436.00	0.09
20	002391	长青股份	3,700	47,286.00	0.09
21	600705	中航资本	10,100	47,167.00	0.09
22	000975	银泰资源	4,640	47,049.60	0.09
23	002478	常宝股份	10,500	47,040.00	0.09
24	002187	广百股份	5,700	46,968.00	0.09
25	600831	广电网络	7,800	46,956.00	0.09
26	002233	塔牌集团	4,100	46,904.00	0.09
27	000552	靖远煤电	14,300	46,761.00	0.09
28	002687	乔治白	8,700	46,719.00	0.09
29	601717	郑煤机	8,000	46,480.00	0.09
30	600664	哈药股份	11,700	46,449.00	0.09
31	600037	歌华有线	4,500	46,440.00	0.09
32	002093	国脉科技	6,000	46,260.00	0.09
33	002603	以岭药业	3,300	46,134.00	0.09
34	600649	城投控股	7,500	45,900.00	0.09
35	000937	冀中能源	11,100	45,621.00	0.09
36	600064	南京高科	6,200	45,508.00	0.09
37	601898	中煤能源	9,400	45,402.00	0.09
38	600557	康缘药业	3,600	44,460.00	0.09
39	002311	海大集团	2,100	44,310.00	0.09
40	300039	上海凯宝	7,600	44,080.00	0.09
41	300040	九洲电气	7,500	44,025.00	0.09
42	300200	高盟新材	5,300	43,990.00	0.09
43	002440	闰土股份	3,750	43,837.50	0.09
44	600585	海螺水泥	1,300	43,524.00	0.08
45	002454	松芝股份	7,300	42,851.00	0.08
46	600061	国投资本	4,600	42,688.00	0.08

47	000153	丰原药业	6,700	42,679.00	0.08
48	002144	宏达高科	3,800	42,446.00	0.08
49	000026	飞亚达 A	4,800	42,336.00	0.08
50	300121	阳谷华泰	3,000	42,090.00	0.08
51	002299	圣农发展	2,700	41,823.00	0.08
52	600088	中视传媒	4,380	41,434.80	0.08
53	002642	荣之联	4,500	41,355.00	0.08
54	000833	粤桂股份	7,900	41,317.00	0.08
55	600639	浦东金桥	3,300	41,184.00	0.08
56	002463	沪电股份	11,000	41,140.00	0.08
57	000548	湖南投资	9,300	40,734.00	0.08
58	300305	裕兴股份	6,700	40,535.00	0.08
59	002373	千方科技	3,100	40,455.00	0.08
60	600757	长江传媒	7,100	40,399.00	0.08
61	002238	天威视讯	6,000	40,380.00	0.08
62	600894	广日股份	6,800	40,324.00	0.08
63	002414	高德红外	3,000	40,320.00	0.08
64	300442	普丽盛	2,400	40,200.00	0.08
65	002064	华峰氨纶	9,600	39,648.00	0.08
66	002304	洋河股份	300	39,480.00	0.08
67	002315	焦点科技	2,700	39,042.00	0.08
68	002561	徐家汇	4,300	38,915.00	0.08
69	000887	中鼎股份	2,700	38,907.00	0.08
70	000858	五粮液	500	38,000.00	0.07
71	601877	正泰电器	1,700	37,944.00	0.07
72	000883	湖北能源	9,100	37,401.00	0.07
73	002398	建研集团	7,300	36,865.00	0.07
74	000419	通程控股	7,600	36,860.00	0.07
75	000568	泸州老窖	600	36,516.00	0.07
76	600887	伊利股份	1,300	36,270.00	0.07
77	600600	青岛啤酒	800	35,064.00	0.07

78	000969	安泰科技	5,600	35,000.00	0.07
79	000028	国药一致	700	34,930.00	0.07
80	300473	德尔股份	900	34,155.00	0.07
81	002330	得利斯	6,400	33,984.00	0.07
82	000592	平潭发展	11,900	33,796.00	0.07
83	002415	海康威视	900	33,417.00	0.07
84	300297	蓝盾股份	4,100	33,251.00	0.06
85	000651	格力电器	700	33,005.00	0.06
86	002217	合力泰	4,000	33,000.00	0.06
87	300422	博世科	2,300	32,775.00	0.06
88	300488	恒锋工具	1,100	32,648.00	0.06
89	300395	菲利华	2,400	32,640.00	0.06
90	002653	海思科	2,700	32,400.00	0.06
91	600153	建发股份	3,600	32,364.00	0.06
92	002599	盛通股份	3,100	32,333.00	0.06
93	600081	东风科技	3,200	32,320.00	0.06
94	000729	燕京啤酒	4,800	32,304.00	0.06
95	600168	武汉控股	5,000	32,300.00	0.06
96	002400	省广集团	10,000	32,300.00	0.06
97	002295	精艺股份	4,800	32,256.00	0.06
98	002205	国统股份	2,700	32,238.00	0.06
99	002107	沃华医药	3,500	32,235.00	0.06
100	002588	史丹利	6,200	32,116.00	0.06
101	002682	龙洲股份	3,900	32,097.00	0.06
102	600888	新疆众和	5,700	32,091.00	0.06
103	002546	新联电子	8,600	32,078.00	0.06
104	600518	康美药业	1,400	32,032.00	0.06
105	300122	智飞生物	700	32,018.00	0.06
106	600019	宝钢股份	4,100	31,939.00	0.06
107	600820	隧道股份	5,400	31,914.00	0.06
108	600248	延长化建	7,100	31,879.00	0.06

109	000682	东方电子	8,300	31,872.00	0.06
110	002654	万润科技	5,800	31,842.00	0.06
111	002317	众生药业	3,000	31,710.00	0.06
112	600516	方大炭素	1,300	31,694.00	0.06
113	000027	深圳能源	6,400	31,616.00	0.06
114	601857	中国石油	4,100	31,611.00	0.06
115	002495	佳隆股份	10,700	31,458.00	0.06
116	600658	电子城	6,000	31,380.00	0.06
117	600170	上海建工	10,300	31,312.00	0.06
118	002243	通产丽星	5,500	31,075.00	0.06
119	000529	广弘控股	5,500	30,910.00	0.06
120	002022	科华生物	2,600	30,810.00	0.06
121	600729	重庆百货	900	29,655.00	0.06
122	300069	金利华电	2,400	28,656.00	0.06
123	002640	跨境通	1,900	28,538.00	0.06
124	002142	宁波银行	1,700	27,693.00	0.05
125	600461	洪城水业	4,400	27,632.00	0.05
126	600352	浙江龙盛	2,300	27,485.00	0.05
127	600613	神奇制药	4,400	26,972.00	0.05
128	000880	潍柴重机	3,500	26,915.00	0.05
129	000966	长源电力	9,700	26,869.00	0.05
130	600640	号百控股	2,600	26,442.00	0.05
131	300239	东宝生物	6,200	26,226.00	0.05
132	600710	苏美达	6,000	25,920.00	0.05
133	300018	中元股份	5,100	25,857.00	0.05
134	300296	利亚德	2,000	25,760.00	0.05
135	002316	亚联发展	2,800	25,760.00	0.05
136	600017	日照港	8,000	25,680.00	0.05
137	600565	迪马股份	8,700	25,665.00	0.05
138	002375	亚厦股份	4,800	25,632.00	0.05
139	001696	宗申动力	5,200	25,480.00	0.05

140	000848	承德露露	2,400	25,416.00	0.05
141	603899	晨光文具	800	25,352.00	0.05
142	000156	华数传媒	2,600	25,064.00	0.05
143	601928	凤凰传媒	4,100	24,928.00	0.05
144	002214	大立科技	4,400	24,068.00	0.05
145	300308	中际旭创	400	24,016.00	0.05
146	000541	佛山照明	4,000	23,960.00	0.05
147	300446	乐凯新材	1,300	23,933.00	0.05
148	600284	浦东建设	4,900	23,912.00	0.05
149	600350	山东高速	5,900	23,895.00	0.05
150	300460	惠伦晶体	2,300	23,805.00	0.05
151	000686	东北证券	3,700	23,717.00	0.05
152	600027	华电国际	6,000	23,520.00	0.05
153	600582	天地科技	6,400	23,488.00	0.05
154	002701	奥瑞金	4,300	23,478.00	0.05
155	601965	中国汽研	2,800	23,464.00	0.05
156	300196	长海股份	2,300	23,437.00	0.05
157	600299	安迪苏	2,000	23,280.00	0.05
158	300119	瑞普生物	2,700	23,085.00	0.04
159	600143	金发科技	4,400	22,968.00	0.04
160	000716	黑芝麻	6,200	22,444.00	0.04
161	600062	华润双鹤	900	22,095.00	0.04
162	603288	海天味业	300	22,092.00	0.04
163	600551	时代出版	2,400	21,216.00	0.04
164	600052	浙江广厦	5,600	20,888.00	0.04
165	600058	五矿发展	2,500	20,775.00	0.04
166	002127	南极电商	2,200	20,658.00	0.04
167	002775	文科园林	1,500	19,770.00	0.04
168	300033	同花顺	500	19,435.00	0.04
169	600809	山西汾酒	300	18,867.00	0.04
170	002399	海普瑞	800	17,712.00	0.03

171	002623	亚玛顿	1,000	17,140.00	0.03
172	603309	维力医疗	1,400	16,884.00	0.03
173	300430	诚益通	1,700	16,847.00	0.03
174	000756	新华制药	1,600	16,512.00	0.03
175	600056	中国医药	900	16,443.00	0.03
176	002276	万马股份	2,800	16,352.00	0.03
177	002559	亚威股份	2,300	16,307.00	0.03
178	600511	国药股份	600	16,170.00	0.03
179	300111	向日葵	5,900	16,166.00	0.03
180	000826	启迪桑德	920	16,081.60	0.03
181	300405	科隆股份	1,800	16,056.00	0.03
182	002551	尚荣医疗	2,600	15,990.00	0.03
183	002251	步步高	1,400	15,932.00	0.03
184	000652	泰达股份	5,100	15,912.00	0.03
185	000705	浙江震元	2,500	15,875.00	0.03
186	000876	新希望	2,500	15,850.00	0.03
187	601005	重庆钢铁	7,800	15,834.00	0.03
188	002297	博云新材	2,600	15,834.00	0.03
189	600706	曲江文旅	1,400	15,820.00	0.03
190	300452	山河药辅	1,100	15,807.00	0.03
191	000898	鞍钢股份	2,800	15,596.00	0.03
192	002533	金杯电工	3,200	15,520.00	0.03
193	600823	世茂股份	3,700	15,466.00	0.03
194	600266	北京城建	1,600	15,040.00	0.03
195	600970	中材国际	2,200	14,696.00	0.03
196	601368	绿城水务	2,100	14,175.00	0.03
197	300408	三环集团	600	14,100.00	0.03
198	300187	永清环保	1,500	13,980.00	0.03
199	600288	大恒科技	1,800	13,968.00	0.03
200	601186	中国铁建	1,600	13,792.00	0.03
201	300423	鲁亿通	600	13,710.00	0.03

202	603808	歌力思	600	13,506.00	0.03
203	000785	武汉中商	1,700	13,090.00	0.03
204	300217	东方电热	5,100	12,240.00	0.02
205	300193	佳士科技	2,100	12,117.00	0.02
206	002201	九鼎新材	1,800	12,078.00	0.02
207	300025	华星创业	2,900	11,977.00	0.02
208	600201	生物股份	700	11,963.00	0.02
209	600611	大众交通	3,000	11,940.00	0.02
210	600780	通宝能源	3,200	11,936.00	0.02
211	600282	南钢股份	2,700	11,934.00	0.02
212	600368	五洲交通	3,700	11,840.00	0.02
213	600377	宁沪高速	1,300	11,804.00	0.02
214	000903	云内动力	4,600	11,776.00	0.02
215	002105	信隆健康	2,600	11,752.00	0.02
216	300144	宋城演艺	500	11,750.00	0.02
217	002403	爱仕达	1,300	11,713.00	0.02
218	600873	梅花生物	2,800	11,704.00	0.02
219	601999	出版传媒	2,100	11,655.00	0.02
220	600267	海正药业	800	11,632.00	0.02
221	600098	广州发展	1,800	11,610.00	0.02
222	600690	青岛海尔	600	11,556.00	0.02
223	002250	联化科技	1,300	11,466.00	0.02
224	300058	蓝色光标	2,000	11,400.00	0.02
225	002050	三花智控	600	11,310.00	0.02
226	002236	大华股份	500	11,275.00	0.02
227	000617	中油资本	1,000	11,240.00	0.02
228	002392	北京利尔	3,300	11,220.00	0.02
229	600819	耀皮玻璃	2,900	11,194.00	0.02
230	300129	泰胜风能	3,100	11,191.00	0.02
231	000999	华润三九	400	11,132.00	0.02
232	000635	英力特	1,200	11,124.00	0.02

233	600586	金晶科技	3,400	11,118.00	0.02
234	000786	北新建材	600	11,118.00	0.02
235	600748	上实发展	2,200	11,088.00	0.02
236	600078	澄星股份	3,200	11,072.00	0.02
237	002498	汉缆股份	5,000	11,050.00	0.02
238	601000	唐山港	4,700	11,045.00	0.02
239	601020	华钰矿业	800	11,032.00	0.02
240	002026	山东威达	1,800	11,016.00	0.02
241	000031	中粮地产	1,900	10,982.00	0.02
242	300041	回天新材	1,200	10,980.00	0.02
243	002404	嘉欣丝绸	1,800	10,980.00	0.02
244	000524	岭南控股	1,200	10,968.00	0.02
245	000862	银星能源	3,500	10,955.00	0.02
246	002084	海鸥住工	2,300	10,948.00	0.02
247	000417	合肥百货	1,900	10,925.00	0.02
248	601567	三星医疗	1,500	10,920.00	0.02
249	002244	滨江集团	2,100	10,920.00	0.02
250	300240	飞力达	1,800	10,908.00	0.02
251	000012	南玻 A	2,200	10,890.00	0.02
252	300325	德威新材	3,200	10,848.00	0.02
253	600050	中国联通	2,200	10,824.00	0.02
254	000900	现代投资	2,600	10,816.00	0.02
255	000906	浙商中拓	2,100	10,794.00	0.02
256	300257	开山股份	700	10,703.00	0.02
257	300371	汇中股份	700	10,647.00	0.02
258	002347	泰尔股份	2,700	10,611.00	0.02
259	300174	元力股份	500	10,590.00	0.02
260	002566	益盛药业	1,500	10,545.00	0.02
261	600189	吉林森工	1,400	10,514.00	0.02
262	000919	金陵药业	1,400	10,486.00	0.02
263	600270	外运发展	500	10,480.00	0.02

264	002667	鞍重股份	1,700	10,438.00	0.02
265	600176	中国巨石	1,000	10,230.00	0.02
266	002090	金智科技	700	10,122.00	0.02
267	002420	毅昌股份	2,200	9,042.00	0.02
268	603123	翠微股份	1,300	7,930.00	0.02
269	000009	中国宝安	1,500	7,350.00	0.01
270	002017	东信和平	1,000	6,210.00	0.01
271	603589	口子窖	100	6,145.00	0.01
272	000090	天健集团	960	5,952.00	0.01
273	300182	捷成股份	700	5,306.00	0.01

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	601799	星宇股份	8,638,056.00	4.01
2	600622	光大嘉宝	8,423,296.38	3.91
3	000818	航锦科技	7,314,507.71	3.40
4	600567	山鹰纸业	7,007,906.90	3.25
5	002080	中材科技	6,925,132.60	3.22
6	002429	兆驰股份	6,768,448.50	3.14
7	002449	国星光电	6,661,483.00	3.09
8	601126	四方股份	6,648,657.54	3.09
9	300271	华宇软件	6,517,247.28	3.03
10	000040	东旭蓝天	6,395,767.89	2.97
11	600470	六国化工	6,367,405.29	2.96
12	600269	赣粤高速	5,985,951.00	2.78
13	600261	阳光照明	5,883,377.00	2.73
14	000042	中洲控股	5,763,869.88	2.68
15	000591	太阳能	5,761,731.80	2.68

16	600331	宏达股份	5,694,457.00	2.64
17	601222	林洋能源	5,660,641.00	2.63
18	300098	高新兴	5,647,686.03	2.62
19	603898	好莱客	5,640,438.00	2.62
20	002025	航天电器	5,593,451.69	2.60
21	002247	帝龙文化	5,570,770.00	2.59
22	600629	华建集团	5,522,897.12	2.57
23	300297	蓝盾股份	5,458,030.02	2.53
24	600172	黄河旋风	5,458,001.80	2.53
25	300157	恒泰艾普	5,424,427.56	2.52
26	000553	沙隆达 A	5,386,367.00	2.50
27	600114	东睦股份	5,382,593.62	2.50
28	600486	扬农化工	5,379,716.35	2.50
29	002483	润邦股份	5,337,107.40	2.48
30	603979	金诚信	5,310,543.92	2.47
31	600491	龙元建设	5,300,083.00	2.46
32	600667	太极实业	5,299,902.00	2.46
33	300050	世纪鼎利	5,284,888.00	2.45
34	000860	顺鑫农业	5,257,857.00	2.44
35	002067	景兴纸业	5,248,356.00	2.44
36	600963	岳阳林纸	5,237,671.81	2.43
37	002383	合众思壮	5,232,902.10	2.43
38	600775	南京熊猫	5,185,579.36	2.41
39	600508	上海能源	5,181,088.53	2.41
40	300485	赛升药业	5,169,935.00	2.40
41	000925	众合科技	5,074,707.19	2.36
42	600803	新奥股份	5,069,671.12	2.35
43	000065	北方国际	5,007,420.01	2.33
44	002372	伟星新材	4,977,039.00	2.31
45	000525	红太阳	4,956,830.00	2.30
46	600143	金发科技	4,928,521.00	2.29

47	600686	金龙汽车	4,924,179.00	2.29
48	000650	仁和药业	4,855,471.00	2.26
49	600057	厦门象屿	4,831,974.04	2.24
50	300447	全信股份	4,787,653.10	2.22
51	000601	韶能股份	4,786,397.75	2.22
52	002680	长生生物	4,785,066.00	2.22
53	600551	时代出版	4,784,575.81	2.22
54	603368	柳药股份	4,773,465.00	2.22
55	002543	万和电气	4,759,068.90	2.21
56	600063	皖维高新	4,739,643.44	2.20
57	000159	国际实业	4,630,887.64	2.15
58	000683	远兴能源	4,621,687.00	2.15
59	600777	新潮能源	4,582,688.00	2.13
60	002393	力生制药	4,526,645.00	2.10
61	600548	深高速	4,470,510.00	2.08
62	002484	江海股份	4,466,675.80	2.07
63	300307	慈星股份	4,456,199.00	2.07
64	600123	兰花科创	4,443,840.00	2.06
65	600035	楚天高速	4,439,885.00	2.06
66	300177	中海达	4,437,996.58	2.06
67	600252	中恒集团	4,428,337.00	2.06
68	600101	明星电力	4,335,066.00	2.01
69	300349	金卡智能	4,334,529.84	2.01
70	300114	中航电测	4,321,670.75	2.01
71	603328	依顿电子	4,308,598.94	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。

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	601799	星宇股份	8,489,840.04	3.94
2	000042	中洲控股	8,063,674.57	3.75
3	600622	光大嘉宝	7,988,562.37	3.71
4	002372	伟星新材	7,742,862.82	3.60
5	600486	扬农化工	7,583,120.65	3.52
6	000553	沙隆达 A	7,458,593.00	3.46
7	002449	国星光电	7,401,610.74	3.44
8	002247	帝龙文化	7,381,195.32	3.43
9	600114	东睦股份	7,366,428.54	3.42
10	002483	润邦股份	7,209,607.82	3.35
11	300271	华宇软件	7,196,955.03	3.34
12	000818	航锦科技	7,045,132.00	3.27
13	600686	金龙汽车	7,028,069.55	3.26
14	600567	山鹰纸业	6,918,931.00	3.21
15	600261	阳光照明	6,654,460.55	3.09
16	002080	中材科技	6,602,431.40	3.07
17	002429	兆驰股份	6,512,080.00	3.02
18	601126	四方股份	6,496,940.64	3.02
19	600491	龙元建设	6,400,538.00	2.97
20	600548	深高速	6,388,570.49	2.97
21	600331	宏达股份	6,372,205.25	2.96
22	600470	六国化工	6,361,836.36	2.95
23	603979	金诚信	6,304,959.54	2.93
24	300447	全信股份	6,272,478.80	2.91
25	300485	赛升药业	6,261,656.20	2.91
26	601107	四川成渝	6,199,196.32	2.88
27	603898	好莱客	6,178,625.80	2.87
28	603368	柳药股份	6,069,877.00	2.82
29	000921	海信科龙	6,002,756.61	2.79
30	300219	鸿利智汇	5,994,580.00	2.78
31	000525	红太阳	5,986,986.40	2.78

32	600508	上海能源	5,969,866.46	2.77
33	600173	卧龙地产	5,944,478.70	2.76
34	000065	北方国际	5,906,802.50	2.74
35	300050	世纪鼎利	5,848,602.30	2.72
36	600323	瀚蓝环境	5,773,041.30	2.68
37	000040	东旭蓝天	5,769,220.40	2.68
38	600269	赣粤高速	5,731,556.00	2.66
39	600285	羚锐制药	5,598,050.00	2.60
40	002121	科陆电子	5,591,279.00	2.60
41	601666	平煤股份	5,576,448.00	2.59
42	000591	太阳能	5,473,639.00	2.54
43	600736	苏州高新	5,459,608.35	2.54
44	300297	蓝盾股份	5,442,099.00	2.53
45	300098	高新兴	5,426,147.77	2.52
46	000860	顺鑫农业	5,420,328.93	2.52
47	002025	航天电器	5,419,946.00	2.52
48	600101	明星电力	5,412,824.60	2.51
49	600172	黄河旋风	5,330,051.60	2.48
50	300194	福安药业	5,297,433.00	2.46
51	600629	华建集团	5,289,166.80	2.46
52	600582	天地科技	5,278,588.00	2.45
53	002100	天康生物	5,261,228.40	2.44
54	600667	太极实业	5,222,444.00	2.43
55	002067	景兴纸业	5,159,530.06	2.40
56	600963	岳阳林纸	5,151,294.04	2.39
57	603669	灵康药业	5,138,818.08	2.39
58	600337	美克家居	5,119,937.48	2.38
59	601222	林洋能源	5,080,100.00	2.36
60	300323	华灿光电	5,071,193.00	2.36
61	600824	益民集团	5,040,655.95	2.34
62	600775	南京熊猫	5,039,592.00	2.34

63	000925	众合科技	4,906,927.05	2.28
64	600057	厦门象屿	4,866,915.92	2.26
65	600035	楚天高速	4,847,538.20	2.25
66	002383	合众思壮	4,822,278.00	2.24
67	002680	长生生物	4,822,146.63	2.24
68	600990	四创电子	4,795,451.80	2.23
69	600105	永鼎股份	4,777,238.52	2.22
70	600551	时代出版	4,775,973.20	2.22
71	600219	南山铝业	4,768,404.00	2.21
72	300157	恒泰艾普	4,767,966.00	2.21
73	000719	中原传媒	4,721,462.28	2.19
74	000650	仁和药业	4,716,872.25	2.19
75	600143	金发科技	4,706,252.00	2.19
76	600803	新奥股份	4,694,693.30	2.18
77	600063	皖维高新	4,645,285.00	2.16
78	000683	远兴能源	4,586,461.00	2.13
79	000601	韶能股份	4,581,525.10	2.13
80	002543	万和电气	4,559,650.73	2.12
81	300114	中航电测	4,528,372.00	2.10
82	300177	中海达	4,488,017.00	2.08
83	000159	国际实业	4,459,938.00	2.07
84	600742	一汽富维	4,453,890.40	2.07
85	002139	拓邦股份	4,407,229.00	2.05
86	300047	天源迪科	4,358,921.15	2.02
87	600252	中恒集团	4,338,887.85	2.02
88	601900	南方传媒	4,333,647.00	2.01
89	002518	科士达	4,308,787.90	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。

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	1,446,054,529.17
卖出股票收入（成交）总额	1,579,067,538.20

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	2,578,707.60	5.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	2,578,707.60	5.03

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	019579	17国债24	17,500	1,752,625.00	3.42
2	019571	17国债17	8,260	826,082.60	1.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2017年10月13日，山鹰国际控股股份公司（下称“山鹰纸业”，股票代码：600567）收到中国证券监督管理委员会的《调查通知书》，中国证监会决定对其财务负责人韩玉红进行立案调查。

据山鹰纸业8月30日发布的公告，山鹰纸业8月29日收到财务负责人韩玉红的报告，其证券账户存在违规买卖公司股票的情况。韩玉红自2017年1月10日起担任公司财务负责人职务。公告显示，韩玉红平时工作繁忙，且对股票交易不甚了解，故证券账户交由家属代为管理和交易。其家属在韩玉红不知情的情况下自2017年8月18日至2017年8月25日期间，通过二级市场合计买入公司股票31,900股，成交均价4.6108元/股，成交金额合计147,086元，并通过二级市场分两次卖出公司股票合计24,500股，成交均价4.6780元/股，成交金额114,610元，累计获利695.86元(扣除相关费用后)，截至目前韩玉红女士证券账户剩余公司股票7,400股。根据相关规定，韩玉红作为山鹰纸业高级管理人员，其证券账户的上述交易行为违反了上市公司董事、监事及高级管理人员在任职期间每年转让的股份不得超过其所持有本公司股份总数的百分之二十五的相关规定；违反了《证券法》第四十七条的规定，构成了短线交易；同时也未能尽到交易报备及预披露的责任。对此，山鹰纸业对韩玉红进行了批评教育、罚款、通报批评的处理，同时，对剩余的7,400股公司股票，董事会要求其在公司任职期内不准减持。韩玉红也表示，对违规买卖公司股票行为进行了深刻反省，已收回证券账户并约束家属股票交易行为，杜绝此类事件再次发生。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，山鹰纸业改正态度积极，并迅速做出反应，积极整改，该事件发生对该公司经营状况无实质影响。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对山鹰纸业进行了投资。

迈克生物股份有限公司（以下简称“迈克生物”）于2017年12月18日收到深圳证券交易所（以下简称“深交所”）《关于对迈克生物股份有限公司股东、时任监事吕磊给予公开谴责处分的公告》（以下简称“处分决定”）

吕磊在迈克生物首次公开发行招股说明书中承诺：“在锁定期满后两年内，本人每年减持公司股份的数量不超过100万股（含100万股）”。2016年5月30日，吕磊所持有的限售股解除限售，获得100万股的减持额度。2016年6月1日，迈克生物实施权益分派，每10股转增20股，吕磊可减持额度从100万股增加至300万股。

2016年6月28日、7月13日及9月5日，吕磊共进行了三笔减持，累计减持300万股，可减持额度已经用完。2017年1月23日、1月26日、2月7日及2月8日，吕磊又进行了四笔减持，合计减持300万股，减持金额63,965,000元，违反了其在首次公开发行招股说明书中所作的承诺。

吕磊的上述相关行为违反了深交所《创业板股票上市规则（2015年修订）》第1.4条、第2.10条和《创业板上市公司规范运作指引（2015年修订）》第4.1.1条、第4.1.4条、第4.3.4条相关规定。

本次减持行为发生后吕磊及迈克生物董事会及时向深交所进行相关事项说明和陈述，同时接受深交所对本次违规行为的处罚意见，吕磊承诺未来加强相关法律法规、规范性文件的学习，加强持有公司股票的证券账户的管理，防止此类事情的再次发生。同时承诺在2018年5月30日前不再减持所持有的公司股份。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，迈克生物改正态度积极，并迅速做出反应，积极整改，本次受深交所处分不会对公司生产经营和财务状况产生重大影响。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对迈克生物进行了投资。

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	133,878.15
2	应收证券清算款	313,051.33
3	应收股利	-
4	应收利息	66,682.30
5	应收申购款	41,063.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	554,675.17
---	----	------------

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

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	000796	凯撒旅游	995,880.00	1.94	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信中证1000增强A	850	19,930.57	5,000,166.70	29.52%	11,940,817.97	70.48%
创金合信中证1	673	64,306.09	34,608,105.81	79.97%	8,669,890.65	20.03%

000增 强C						
合计	1,474	40,854.13	39,608,272.51	65.77%	20,610,708.62	34.23%

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	创金合信中证1000增强A	71,775.67	0.42%
	创金合信中证1000增强C	162,306.11	0.38%
	合计	234,081.78	0.39%

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

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	10,000,333.36	16.61%	10,000,333.36	16.61%	36月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,333.36	16.61%	10,000,333.36	16.61%	-

§ 9 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	11,023,486.67	54,018,573.65
减：本报告期基金总赎回份额	204,498,196.76	20,994,505.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,940,984.67	43,277,996.46

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金元证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	3,023,656,411.28	100.00%	1,269,459.84	100.00%	-

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
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	12,375,705.65	100.00%	70,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、证券时报	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
8	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
9	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
10	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
11	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
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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101 - 201803 26	158,930,244.65	0.00	158,930,244.65	0.00	0.00%
	2	20180208 - 201803 27	39,847,579.20	0.00	39,847,579.20	0.00	0.00%
	3	20180328 - 201804 12	10,000,333.36	0.00	0.00	10,000,333.36	16.61%
	4	20180328 - 201806 30	0.00	20,839,564.75	5,000,000.00	15,839,564.75	26.30%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；</p>							

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内, 未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证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年半年度报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日