**创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金**

**2018年年度报告**

**2018年12月31日**

**基金管理人:创金合信基金管理有限公司**

**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**

**送出日期:2019年03月29日**

**§1  重要提示及目录**

**1.1 重要提示**

|  |
| --- |
| 基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。  本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。 |

**1.2 目录**

**[§1  重要提示及目录](#_Toc4173035)** [2](#_Toc4173035)

**[1.1 重要提示](#_Toc4173036)** [2](#_Toc4173036)

**[1.2 目录](#_Toc4173037)** [3](#_Toc4173037)

**[§2  基金简介](#_Toc4173038)** [5](#_Toc4173038)

**[2.1 基金基本情况](#_Toc4173039)** [5](#_Toc4173039)

**[2.2 基金产品说明](#_Toc4173040)** [5](#_Toc4173040)

**[2.3 基金管理人和基金托管人](#_Toc4173041)** [6](#_Toc4173041)

**[2.4 信息披露方式](#_Toc4173042)** [6](#_Toc4173042)

**[2.5 其他相关资料](#_Toc4173043)** [6](#_Toc4173043)

**[§3  主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况](#_Toc4173044)** [7](#_Toc4173044)

**[3.1 主要会计数据和财务指标](#_Toc4173045)** [7](#_Toc4173045)

**[3.2 基金净值表现](#_Toc4173046)** [8](#_Toc4173046)

**[3.3 过去三年基金的利润分配情况](#_Toc4173047)** [11](#_Toc4173047)

**[§4  管理人报告](#_Toc4173048)** [11](#_Toc4173048)

**[4.1 基金管理人及基金经理情况](#_Toc4173049)** [11](#_Toc4173049)

**[4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#_Toc4173050)** [13](#_Toc4173050)

**[4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#_Toc4173051)** [13](#_Toc4173051)

**[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](#_Toc4173052)** [14](#_Toc4173052)

**[4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#_Toc4173053)** [15](#_Toc4173053)

**[4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况](#_Toc4173054)** [15](#_Toc4173054)

**[4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#_Toc4173055)** [16](#_Toc4173055)

**[4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#_Toc4173056)** [16](#_Toc4173056)

**[4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明](#_Toc4173057)** [16](#_Toc4173057)

**[§5  托管人报告](#_Toc4173058)** [16](#_Toc4173058)

**[5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#_Toc4173059)** [16](#_Toc4173059)

**[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](#_Toc4173060)** [16](#_Toc4173060)

**[5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见](#_Toc4173061)** [16](#_Toc4173061)

**[§6  审计报告](#_Toc4173062)** [17](#_Toc4173062)

**[6.1 审计报告基本信息](#_Toc4173063)** [17](#_Toc4173063)

**[6.2 审计报告的基本内容](#_Toc4173064)** [17](#_Toc4173064)

**[§7  年度财务报表](#_Toc4173065)** [19](#_Toc4173065)

**[7.1 资产负债表](#_Toc4173066)** [19](#_Toc4173066)

**[7.2 利润表](#_Toc4173067)** [21](#_Toc4173067)

**[7.3 所有者权益（基金净值）变动表](#_Toc4173068)** [23](#_Toc4173068)

**[7.4 报表附注](#_Toc4173069)** [24](#_Toc4173069)

**[§8 投资组合报告](#_Toc4173070)** [53](#_Toc4173070)

**[8.1 期末基金资产组合情况](#_Toc4173071)** [53](#_Toc4173071)

**[8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合](#_Toc4173072)** [54](#_Toc4173072)

**[8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细](#_Toc4173073)** [56](#_Toc4173073)

**[8.4 报告期内股票投资组合的重大变动](#_Toc4173074)** [85](#_Toc4173074)

**[8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合](#_Toc4173075)** [92](#_Toc4173075)

**[8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细](#_Toc4173076)** [92](#_Toc4173076)

**[8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细](#_Toc4173077)** [93](#_Toc4173077)

**[8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细](#_Toc4173078)** [93](#_Toc4173078)

**[8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细](#_Toc4173079)** [93](#_Toc4173079)

**[8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#_Toc4173080)** [93](#_Toc4173080)

**[8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#_Toc4173081)** [93](#_Toc4173081)

**[8.12 投资组合报告附注](#_Toc4173082)** [93](#_Toc4173082)

**[§9  基金份额持有人信息](#_Toc4173083)** [95](#_Toc4173083)

**[9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构](#_Toc4173084)** [95](#_Toc4173084)

**[9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况](#_Toc4173085)** [95](#_Toc4173085)

**[9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况](#_Toc4173086)** [96](#_Toc4173086)

**[9.4发起式基金发起资金持有份额情况](#_Toc4173087)** [96](#_Toc4173087)

**[§10  开放式基金份额变动](#_Toc4173088)** [96](#_Toc4173088)

**[§11  重大事件揭示](#_Toc4173089)** [97](#_Toc4173089)

**[11.1 基金份额持有人大会决议](#_Toc4173090)** [97](#_Toc4173090)

**[11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动](#_Toc4173091)** [97](#_Toc4173091)

**[11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼](#_Toc4173092)** [97](#_Toc4173092)

**[11.4 基金投资策略的改变](#_Toc4173093)** [97](#_Toc4173093)

**[11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况](#_Toc4173094)** [97](#_Toc4173094)

**[11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况](#_Toc4173095)** [97](#_Toc4173095)

**[11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况](#_Toc4173096)** [97](#_Toc4173096)

**[11.8 其他重大事件](#_Toc4173097)** [98](#_Toc4173097)

**[§12 影响投资者决策的其他重要信息](#_Toc4173098)** [103](#_Toc4173098)

**[12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况](#_Toc4173099)** [103](#_Toc4173099)

**[12.2 影响投资者决策的其他重要信息](#_Toc4173100)** [104](#_Toc4173100)

**[§13  备查文件目录](#_Toc4173101)** [104](#_Toc4173101)

**[13.1 备查文件目录](#_Toc4173102)** [104](#_Toc4173102)

**[13.2 存放地点](#_Toc4173103)** [105](#_Toc4173103)

**[13.3 查阅方式](#_Toc4173104)** [105](#_Toc4173104)

**§2  基金简介**

**2.1 基金基本情况**

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

**2.2 基金产品说明**

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

**2.3 基金管理人和基金托管人**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
| 名称 | | 创金合信基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 梁绍锋 | 贺倩 |
| 联系电话 | 0755-23838908 | 010-66060069 |
| 电子邮箱 | liangshaofeng@cjhxfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-0666 | 95599 |
| 传真 | | 0755-25832571 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15层 | 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | | 518000 | 100031 |
| 法定代表人 | | 刘学民 | 周慕冰 |

**2.4 信息披露方式**

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

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

**2.5 其他相关资料**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 创金合信基金管理有限公司 | 深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15层 |

**§3  主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**

**3.1 主要会计数据和财务指标**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **3.1.1 期间数据和指标** | 2018年 | | 2017年 | | 2016年12月22日（基金合同生效日）-2016年12月31日 | |
| 创金合信中证1000增强A | 创金合信中证1000增强C | 创金合信中证1000增强A | 创金合信中证1000增强C | 创金合信中证1000增强A | 创金合信中证1000增强C |
| 本期已实现收益 | -14,374,051.88 | -8,398,136.00 | -4,982,142.06 | -213,418.70 | -2,327.16 | -2,613.13 |
| 本期利润 | -14,820,436.86 | -8,434,091.20 | -6,204,641.10 | -188,997.31 | -56,916.20 | -58,007.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2546 | -0.2978 | -0.0309 | -0.0272 | -0.0113 | -0.0114 |
| 本期加权平均净值利润率 | -27.55% | -34.31% | -3.16% | -2.78% | -1.14% | -1.15% |
| 本期基金份额净值增长率 | -23.70% | -23.76% | -1.31% | -1.34% | -1.13% | -1.14% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 2018年末 | | 2017年末 | | 2016年末 | |
| 期末可供分配利润 | -8,356,396.21 | -9,899,925.48 | -5,662,246.40 | -279,083.96 | -56,903.46 | -58,104.09 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3093 | -0.3102 | -0.0269 | -0.0272 | -0.0113 | -0.0114 |
| 期末基金资产净值 | 20,116,169.03 | 23,730,901.58 | 205,305,541.73 | 10,001,754.96 | 4,965,656.23 | 5,048,168.18 |
| 期末基金份额净值 | 0.7445 | 0.7436 | 0.9757 | 0.9754 | 0.9887 | 0.9886 |
| **3.1.3 累计期末指标** | 2018年末 | | 2017年末 | | 2016年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | -25.55% | -25.64% | -2.43% | -2.46% | -1.13% | -1.14% |

注：1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
3.期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

**3.2 基金净值表现**

**3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

创金合信中证1000增强A

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | -7.19% | 1.76% | -10.58% | 1.80% | 3.39% | -0.04% |
| 过去六个月 | -12.63% | 1.50% | -19.98% | 1.54% | 7.35% | -0.04% |
| 过去一年 | -23.70% | 1.46% | -35.26% | 1.48% | 11.56% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -25.55% | 1.21% | -46.61% | 1.24% | 21.06% | -0.03% |

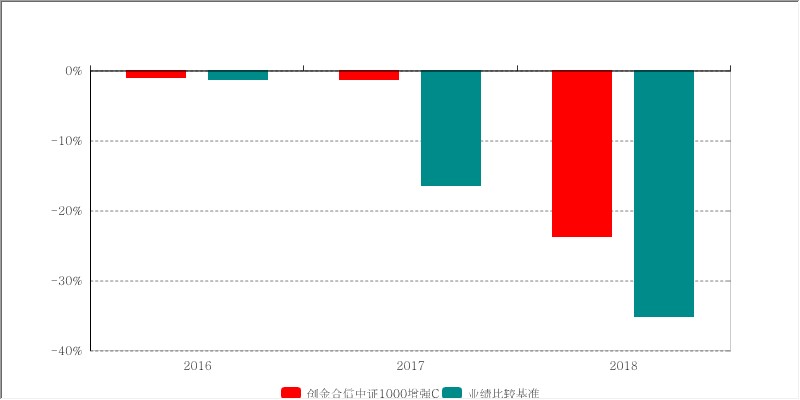
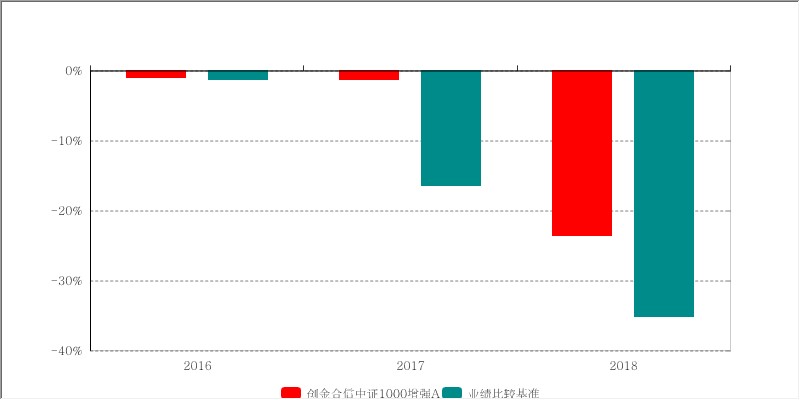
创金合信中证1000增强C

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

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



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



**3.3 过去三年基金的利润分配情况**

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

**§4  管理人报告**

**4.1 基金管理人及基金经理情况**

**4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验**

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

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

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

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
| 任职日期 | 离任日期 |
| 庞世恩 | 本基金基金经理 | 2016-12-22 | 2018-08-31 | 7年 | 庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，2016年12月至2018年8月担任本基金基金经理。 |
| 程志田 | 本基金基金经理、量化投资部总监 | 2016-12-22 | - | 12年 | 程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。 |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；  
2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法**

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称"本公司"）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

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

4、公平交易监控

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

**4.3.2 公平交易制度的执行情况**

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

**4.3.3 异常交易行为的专项说明**

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

**4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

**4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

回顾2018年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。

**4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

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

**4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

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

**4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

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

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

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

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

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

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

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

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

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

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

（9）建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

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

**4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

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

**4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

**4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

**§5  托管人报告**

**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

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

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

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

**§6  审计报告**

**6.1 审计报告基本信息**

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

**6.2 审计报告的基本内容**

|  |  |
| --- | --- |
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金 全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“ 创金合信中证1000增强基金”)的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年度  的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了创金合信中证1000增强基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于创金合信中证1000增强基金 ，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 |  |
| 其他事项 |  |
| 其他信息 |  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 创金合信中证1000增强基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估创金合信中证1000增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算创金合信中证1000增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督创金合信中证1000增强基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对创金合信中证1000增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致创金合信中证1000增强基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 曹翠丽、边晓红 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 |
| 审计报告日期 | 2019-03-26 |

**§7  年度财务报表**

**7.1 资产负债表**

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **资 产** | **附注号** | 本期末  2018年12月31日 | 上年度末  2017年12月31日 |
| **资 产：** |  |  |  |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 801,785.36 | 3,656,874.22 |
| 结算备付金 |  | 696,932.85 | 3,011,126.34 |
| 存出保证金 |  | 33,180.97 | 110,107.64 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 42,451,516.03 | 207,208,031.86 |
| 其中：股票投资 |  | 40,222,935.23 | 196,110,171.06 |
| 基金投资 |  | - | - |
| 债券投资 |  | 2,228,580.80 | 11,097,860.80 |
| 资产支持证券投资 |  | - | - |
| 贵金属投资 |  | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 |  | - | 1,993,099.38 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 61,785.93 | 65,650.24 |
| 应收股利 |  | - | - |
| 应收申购款 |  | 125,567.78 | 615,783.90 |
| 递延所得税资产 |  | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 |  | 44,170,768.92 | 216,660,673.58 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | 本期末  2018年12月31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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 |  | - | - |
| 应付证券清算款 |  | - | - |
| 应付赎回款 |  | 25,546.94 | 20,455.61 |
| 应付管理人报酬 |  | 29,990.46 | 144,506.50 |
| 应付托管费 |  | 5,623.23 | 27,094.96 |
| 应付销售服务费 |  | 3,993.92 | 1,613.21 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 88,543.41 | 1,014,705.99 |
| 应交税费 |  | 0.35 | - |
| 应付利息 |  | - | - |
| 应付利润 |  | - | - |
| 递延所得税负债 |  | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 170,000.00 | 145,000.62 |
| 负债合计 |  | 323,698.31 | 1,353,376.89 |
| **所有者权益：** |  |  |  |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 58,934,800.32 | 220,669,622.69 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -15,087,729.71 | -5,362,326.00 |
| 所有者权益合计 |  | 43,847,070.61 | 215,307,296.69 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 44,170,768.92 | 216,660,673.58 |

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

**7.2 利润表**

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项 目** | **附注号** | 本期2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
|
| **一、收入** |  | -18,251,396.46 | 2,178,924.03 |
| 1.利息收入 |  | 184,686.84 | 131,154.39 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 47,693.62 | 121,270.41 |
| 债券利息收入 |  | 135,838.71 | 9,883.98 |
| 资产支持证券利息收入 |  | - | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | 1,154.51 | - |
| 其他利息收入 |  | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | -18,057,855.68 | 3,224,768.48 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -18,510,212.48 | 1,929,523.47 |
| 基金投资收益 |  | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 21,106.66 | 13,125.03 |
| 资产支持证券投资收益 |  | - | - |
| 贵金属投资收益 |  | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 431,250.14 | 1,282,119.98 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -482,340.18 | -1,198,077.65 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） |  | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 104,112.56 | 21,078.81 |
| **减：二、费用** |  | 5,003,131.60 | 8,572,562.44 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 630,834.22 | 1,623,015.99 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 118,281.34 | 304,315.56 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 48,739.29 | 13,562.33 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.18 | 3,977,743.62 | 6,450,010.74 |
| 5．利息支出 |  | 21,729.33 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | 21,729.33 | - |
| 6．税金及附加 |  | 0.72 | - |
| 7．其他费用 | 7.4.7.19 | 205,803.08 | 181,657.82 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** |  | -23,254,528.06 | -6,393,638.41 |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** |  | -23,254,528.06 | -6,393,638.41 |

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项 目** | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | | |
| 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 220,669,622.69 | -5,362,326.00 | 215,307,296.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -23,254,528.06 | -23,254,528.06 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -161,734,822.37 | 13,529,124.35 | -148,205,698.02 |
| 其中：1.基金申购款 | 99,011,771.99 | -10,059,264.86 | 88,952,507.13 |
| 2.基金赎回款 | -260,746,594.36 | 23,588,389.21 | -237,158,205.15 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 58,934,800.32 | -15,087,729.71 | 43,847,070.61 |
| **项 目** | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 | | |
| 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 10,128,831.96 | -115,007.55 | 10,013,824.41 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -6,393,638.41 | -6,393,638.41 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 210,540,790.73 | 1,146,319.96 | 211,687,110.69 |
| 其中：1.基金申购款 | 220,370,635.75 | 905,967.13 | 221,276,602.88 |
| 2.基金赎回款 | -9,829,845.02 | 240,352.83 | -9,589,492.19 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 220,669,622.69 | -5,362,326.00 | 215,307,296.69 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 苏彦祝  —————————  基金管理人负责人 | 黄越岷  —————————  主管会计工作负责人 | 安兆国  —————————  会计机构负责人 |

**7.4 报表附注**

**7.4.1 基金基本情况**

创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]1918号《关于准予创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,115,380.08元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1553号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,115,717.42份基金份额，其中认购资金利息折合337.34份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")。

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

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

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

**7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

**7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

**7.4.4 重要会计政策和会计估计**

**7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

**7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

**7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

**7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

**7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

**7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

**7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

**7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金的收益分配政策为：（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；（4）同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

**7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

**7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

**7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

**7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

**7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

**7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

**7.4.6 税项**

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

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

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

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

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

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

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

**7.4.7 重要财务报表项目的说明**

**7.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2018年12月31日 | 上年度末  2017年12月31日 |
| 活期存款 | 801,785.36 | 3,656,874.22 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | - |
| 存款期限1-3个月 | - | - |
| 存款期限3个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 801,785.36 | 3,656,874.22 |

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 本期末2018年12月31日 | | |
| 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 42,013,085.28 | 40,222,935.23 | -1,790,150.05 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,228,832.00 | 2,228,580.80 | -251.20 |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | 2,228,832.00 | 2,228,580.80 | -251.20 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 44,241,917.28 | 42,451,516.03 | -1,790,401.25 |
| 项目 | | 上年度末2017年12月31日 | | |
| 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 197,395,992.93 | 196,110,171.06 | -1,285,821.87 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 11,120,100.00 | 11,097,860.80 | -22,239.20 |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | 11,120,100.00 | 11,097,860.80 | -22,239.20 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 208,516,092.93 | 207,208,031.86 | -1,308,061.07 |

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2018年12月31日 | 上年度末  2017年12月31日 |
| 应收活期存款利息 | 179.49 | 1,997.46 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 344.85 | 1,490.50 |
| 应收债券利息 | 61,245.20 | 62,107.83 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 16.39 | 54.45 |
| 合计 | 61,785.93 | 65,650.24 |

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

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

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

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

**7.4.7.9 实收基金**

**7.4.7.9.1 创金合信中证1000增强A**

金额单位：人民币元

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

**7.4.7.9.2 创金合信中证1000增强C**

金额单位：人民币元

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

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

**7.4.7.10 未分配利润**

**7.4.7.10.1 创金合信中证1000增强A**

单位：人民币元

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

**7.4.7.10.2 创金合信中证1000增强C**

单位：人民币元

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

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 13,874.01 | 78,276.59 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 32,143.51 | 41,655.28 |
| 其他 | 1,676.10 | 1,338.54 |
| 合计 | 47,693.62 | 121,270.41 |

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 2,079,764,895.29 | 3,437,366,302.03 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,098,275,107.77 | 3,435,436,778.56 |
| 买卖股票差价收入 | -18,510,212.48 | 1,929,523.47 |

**7.4.7.13 债券投资收益**

**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 21,106.66 | 13,125.03 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 21,106.66 | 13,125.03 |

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 14,231,578.87 | 487,810.50 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 13,963,322.70 | 472,500.00 |
| 减：应收利息总额 | 247,149.51 | 2,185.47 |
| 买卖债券差价收入 | 21,106.66 | 13,125.03 |

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

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

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目名称 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | -482,340.18 | -1,198,077.65 |
| ——股票投资 | -504,328.18 | -1,175,838.45 |
| ——债券投资 | 21,988.00 | -22,239.20 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | -482,340.18 | -1,198,077.65 |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

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

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

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

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

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

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

**7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

|  |  |
| --- | --- |
| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| 创金合信基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 农业银行股份有限公司(“农业银行”) | 基金托管人 |
| 第一创业证券股份有限公司(“第一创业证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | |
| 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 3,291,124,477.15 | 81.85% | 4,202,818,751.90 | 59.58% |

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | |
| 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 13,400,879.65 | 83.27% | 11,469,138.01 | 100.00% |

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | |
| 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 78,500,000.00 | 75.85% | - | - |

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | | |
| 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1,381,218.55 | 89.63% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | | | |
| 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1,764,418.52 | 73.93% | 1,014,705.99 | 100.00% |

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

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 630,834.22 | 1,623,015.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 89,288.17 | 17,620.46 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：  
H＝E×0.80%÷当年天数  
H为每日应计提的基金管理费  
E为前一日的基金资产净值  
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

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

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：  
H＝E×0.15%÷当年天数  
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基金资产净值  
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | | |
| 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| 创金合信中证1000增强A | 创金合信中证1000增强C | 合计 |
| 创金合信直销 | 0.00 | 32,638.78 | 32,638.78 |
| 合计 | 0.00 | 32,638.78 | 32,638.78 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 | | |
| 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| 创金合信中证1000增强A | 创金合信中证1000增强C | 合计 |
| 创金合信直销 | 0.00 | 9,777.42 | 9,777.42 |
| 合计 | 0.00 | 9,777.42 | 9,777.42 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：  
H＝E×0.20%÷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  
销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。  
销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

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

创金合信中证1000增强A

份额单位：份

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

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

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

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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  2018年01月01日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间  2017年01月01日至2017年12月31日 | |
| 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 801,785.36 | 13,874.01 | 3,656,874.22 | 78,276.59 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业存款利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况--非货币市场基金**

本基金于本期未进行利润分配。

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

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

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

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 000708 | 大冶特钢 | 2018-12-25 | 重大事项停牌 | 8.77 | 2019-01-03 | 9.65 | 800 | 6,944.00 | 7,016.00 | - |

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

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

**7.4.13 金融工具风险及管理**

**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

**7.4.13.2 信用风险**

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

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

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

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

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

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 长期信用评级 | 本期末  2018年12月31日 | 上年度末  2017年12月31日 |
| AAA | - | 490,240.80 |
| AAA以下 | 28,944.80 | 32,000.00 |
| 未评级 | 2,199,636.00 | 0.00 |
| 合计 | 2,228,580.80 | 522,240.80 |

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

于2018年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2018年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.03%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为43,428,097.80元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

**7.4.13.4 市场风险**

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

**7.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 本期末2018年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 |  |  |  |  |  |
| 银行存款 | 801,785.36 | - | - | - | 801,785.36 |
| 结算备付金 | 696,932.85 | - | - | - | 696,932.85 |
| 存出保证金 | 33,180.97 | - | - | - | 33,180.97 |
| 交易性金融资产 | 2,199,636.00 | - | 28,944.80 | 40,222,935.23 | 42,451,516.03 |
| 应收利息 | - | - | - | 61,785.93 | 61,785.93 |
| 应收申购款 | - | - | - | 125,567.78 | 125,567.78 |
| 资产总计 | 3,731,535.18 | - | 28,944.80 | 40,410,288.94 | 44,170,768.92 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 25,546.94 | 25,546.94 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 29,990.46 | 29,990.46 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,623.23 | 5,623.23 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 3,993.92 | 3,993.92 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 88,543.41 | 88,543.41 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.35 | 0.35 |
| 其他负债 | - | - | - | 170,000.00 | 170,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 323,698.31 | 323,698.31 |
| 利率敏感度缺口 | 3,731,535.18 | - | 28,944.80 | 40,086,590.63 | 43,847,070.61 |
| 上年度末2017年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 |  |  |  |  |  |
| 银行存款 | 3,656,874.22 | - | - | - | 3,656,874.22 |
| 结算备付金 | 3,011,126.34 | - | - | - | 3,011,126.34 |
| 存出保证金 | 110,107.64 | - | - | - | 110,107.64 |
| 交易性金融资产 | 10,575,620.00 | 490,240.80 | 32,000.00 | 196,110,171.06 | 207,208,031.86 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,993,099.38 | 1,993,099.38 |
| 应收利息 | - | - | - | 65,650.24 | 65,650.24 |
| 应收申购款 | - | - | - | 615,783.90 | 615,783.90 |
| 资产总计 | 17,353,728.20 | 490,240.80 | 32,000.00 | 198,784,704.58 | 216,660,673.58 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 20,455.61 | 20,455.61 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 144,506.50 | 144,506.50 |
| 应付托管费 | - | - | - | 27,094.96 | 27,094.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,613.21 | 1,613.21 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,014,705.99 | 1,014,705.99 |
| 其他负债 | - | - | - | 145,000.62 | 145,000.62 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,353,376.89 | 1,353,376.89 |
| 利率敏感度缺口 | 17,353,728.20 | 490,240.80 | 32,000.00 | 197,431,327.69 | 215,307,296.69 |

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

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

于2018年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.08%(2017年12月31日：5.16%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

**7.4.13.4.2 外汇风险**

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

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

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

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

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2018年12月31日 | | 上年度末  2017年12月31日 | |
| 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产－股票投资 | 40,222,935.23 | 91.73 | 196,110,171.06 | 91.08 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 40,222,935.23 | 91.73 | 196,110,171.06 | 91.08 |

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| 本期末  2018年12月31日 | 上年度末  2017年12月31日 |
| 比较基准上涨5%资产净值变动 | 2,016,052.84 | 8,892,532.64 |
| 比较基准下降5%资产净值变动 | -2,016,052.84 | -8,892,532.64 |

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为40,239,864.03元，属于第二层次的余额为2,211,652.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次184,733,660.40元，第二层次22,474,371.46元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§8 投资组合报告**

**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
| 1 | 权益投资 | 40,222,935.23 | 91.06 |
|  | 其中：股票 | 40,222,935.23 | 91.06 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,228,580.80 | 5.05 |
|  | 其中：债券 | 2,228,580.80 | 5.05 |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,498,718.21 | 3.39 |
| 8 | 其他各项资产 | 220,534.68 | 0.50 |
| 9 | 合计 | 44,170,768.92 | 100.00 |

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| A | 农、林、牧、渔业 | 457,320.00 | 1.04 |
| B | 采矿业 | 829,834.00 | 1.89 |
| C | 制造业 | 20,798,213.22 | 47.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,136,021.00 | 2.59 |
| E | 建筑业 | 770,761.00 | 1.76 |
| F | 批发和零售业 | 1,311,187.00 | 2.99 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 835,907.70 | 1.91 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,521,778.00 | 8.03 |
| J | 金融业 | 115,536.60 | 0.26 |
| K | 房地产业 | 1,373,050.00 | 3.13 |
| L | 租赁和商务服务业 | 178,928.00 | 0.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 341,760.00 | 0.78 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 593,611.00 | 1.35 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 44,988.00 | 0.10 |
| Q | 卫生和社会工作 | 63,855.00 | 0.15 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 671,708.00 | 1.53 |
| S | 综合 | 39,120.00 | 0.09 |
|  | 合计 | 33,083,578.52 | 75.45 |

**8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合**

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

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

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

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 600873 | 梅花生物 | 39,100 | 165,002.00 | 0.38 |
| 2 | 002138 | 顺络电子 | 11,500 | 159,160.00 | 0.36 |
| 3 | 000977 | 浪潮信息 | 9,800 | 156,016.00 | 0.36 |
| 4 | 300285 | 国瓷材料 | 8,500 | 141,695.00 | 0.32 |
| 5 | 000883 | 湖北能源 | 37,800 | 138,726.00 | 0.32 |
| 6 | 002383 | 合众思壮 | 11,600 | 137,228.00 | 0.31 |
| 7 | 600252 | 中恒集团 | 53,200 | 136,724.00 | 0.31 |
| 8 | 600675 | 中华企业 | 24,200 | 135,036.00 | 0.31 |
| 9 | 002376 | 新北洋 | 8,800 | 134,992.00 | 0.31 |
| 10 | 600745 | 闻泰科技 | 6,300 | 133,119.00 | 0.30 |
| 11 | 600323 | 瀚蓝环境 | 9,200 | 129,076.00 | 0.29 |
| 12 | 300038 | 数知科技 | 13,700 | 127,821.00 | 0.29 |
| 13 | 600320 | 振华重工 | 39,740 | 125,975.80 | 0.29 |
| 14 | 000591 | 太阳能 | 42,400 | 125,504.00 | 0.29 |
| 15 | 600803 | 新奥股份 | 12,400 | 123,256.00 | 0.28 |
| 16 | 600797 | 浙大网新 | 17,000 | 122,570.00 | 0.28 |
| 17 | 600728 | 佳都科技 | 17,500 | 120,575.00 | 0.27 |
| 18 | 002126 | 银轮股份 | 16,200 | 120,528.00 | 0.27 |
| 19 | 300271 | 华宇软件 | 8,000 | 120,080.00 | 0.27 |
| 20 | 000902 | 新洋丰 | 13,300 | 119,168.00 | 0.27 |
| 21 | 002396 | 星网锐捷 | 6,900 | 118,818.00 | 0.27 |
| 22 | 600490 | 鹏欣资源 | 26,000 | 118,300.00 | 0.27 |
| 23 | 002697 | 红旗连锁 | 22,900 | 117,477.00 | 0.27 |
| 24 | 002610 | 爱康科技 | 74,500 | 116,965.00 | 0.27 |
| 25 | 002151 | 北斗星通 | 5,500 | 116,050.00 | 0.26 |
| 26 | 002025 | 航天电器 | 5,400 | 115,722.00 | 0.26 |
| 27 | 603517 | 绝味食品 | 3,400 | 112,574.00 | 0.26 |
| 28 | 002419 | 天虹股份 | 10,200 | 111,894.00 | 0.26 |
| 29 | 300601 | 康泰生物 | 3,100 | 110,918.00 | 0.25 |
| 30 | 600845 | 宝信软件 | 5,300 | 110,505.00 | 0.25 |
| 31 | 000059 | 华锦股份 | 18,600 | 110,484.00 | 0.25 |
| 32 | 002449 | 国星光电 | 10,600 | 110,028.00 | 0.25 |
| 33 | 600486 | 扬农化工 | 2,900 | 109,214.00 | 0.25 |
| 34 | 002042 | 华孚时尚 | 20,100 | 109,143.00 | 0.25 |
| 35 | 600337 | 美克家居 | 27,100 | 107,045.00 | 0.24 |
| 36 | 300284 | 苏交科 | 10,300 | 106,811.00 | 0.24 |
| 37 | 000793 | 华闻传媒 | 35,600 | 105,732.00 | 0.24 |
| 38 | 601058 | 赛轮轮胎 | 47,400 | 105,702.00 | 0.24 |
| 39 | 600562 | 国睿科技 | 8,100 | 104,247.00 | 0.24 |
| 40 | 000683 | 远兴能源 | 43,600 | 103,332.00 | 0.24 |
| 41 | 300207 | 欣旺达 | 12,000 | 103,080.00 | 0.24 |
| 42 | 300036 | 超图软件 | 5,600 | 102,648.00 | 0.23 |
| 43 | 600269 | 赣粤高速 | 26,300 | 102,570.00 | 0.23 |
| 44 | 300294 | 博雅生物 | 3,800 | 102,562.00 | 0.23 |
| 45 | 000650 | 仁和药业 | 18,700 | 102,476.00 | 0.23 |
| 46 | 002614 | 奥佳华 | 6,400 | 102,080.00 | 0.23 |
| 47 | 000836 | 富通鑫茂 | 26,100 | 101,529.00 | 0.23 |
| 48 | 002262 | 恩华药业 | 11,200 | 101,024.00 | 0.23 |
| 49 | 002099 | 海翔药业 | 22,300 | 100,796.00 | 0.23 |
| 50 | 002020 | 京新药业 | 11,700 | 100,620.00 | 0.23 |
| 51 | 600123 | 兰花科创 | 15,400 | 100,408.00 | 0.23 |
| 52 | 000036 | 华联控股 | 18,200 | 100,282.00 | 0.23 |
| 53 | 000560 | 我爱我家 | 21,400 | 99,938.00 | 0.23 |
| 54 | 601588 | 北辰实业 | 36,600 | 99,186.00 | 0.23 |
| 55 | 600330 | 天通股份 | 17,900 | 98,629.00 | 0.22 |
| 56 | 000875 | 吉电股份 | 40,200 | 98,490.00 | 0.22 |
| 57 | 002073 | 软控股份 | 21,600 | 97,848.00 | 0.22 |
| 58 | 002402 | 和而泰 | 15,800 | 97,644.00 | 0.22 |
| 59 | 603368 | 柳药股份 | 3,700 | 96,940.00 | 0.22 |
| 60 | 600711 | 盛屯矿业 | 21,200 | 96,884.00 | 0.22 |
| 61 | 600577 | 精达股份 | 32,500 | 96,525.00 | 0.22 |
| 62 | 600033 | 福建高速 | 32,300 | 95,931.00 | 0.22 |
| 63 | 002145 | 中核钛白 | 29,700 | 95,634.00 | 0.22 |
| 64 | 600491 | 龙元建设 | 14,100 | 95,457.00 | 0.22 |
| 65 | 600851 | 海欣股份 | 13,700 | 95,078.00 | 0.22 |
| 66 | 300185 | 通裕重工 | 58,600 | 94,346.00 | 0.22 |
| 67 | 000789 | 万年青 | 8,600 | 93,654.00 | 0.21 |
| 68 | 600420 | 现代制药 | 10,200 | 93,228.00 | 0.21 |
| 69 | 600708 | 光明地产 | 26,700 | 93,183.00 | 0.21 |
| 70 | 600067 | 冠城大通 | 25,000 | 93,000.00 | 0.21 |
| 71 | 600681 | 百川能源 | 7,800 | 92,352.00 | 0.21 |
| 72 | 000901 | 航天科技 | 10,400 | 91,936.00 | 0.21 |
| 73 | 002022 | 科华生物 | 9,800 | 91,924.00 | 0.21 |
| 74 | 000676 | 智度股份 | 9,600 | 91,104.00 | 0.21 |
| 75 | 300226 | 上海钢联 | 2,000 | 91,060.00 | 0.21 |
| 76 | 300098 | 高新兴 | 13,400 | 90,584.00 | 0.21 |
| 77 | 000697 | 炼石航空 | 7,300 | 90,447.00 | 0.21 |
| 78 | 603708 | 家家悦 | 4,500 | 90,405.00 | 0.21 |
| 79 | 000546 | 金圆股份 | 10,400 | 90,064.00 | 0.21 |
| 80 | 002717 | 岭南股份 | 10,100 | 89,991.00 | 0.21 |
| 81 | 000016 | 深康佳Ａ | 27,700 | 89,748.00 | 0.20 |
| 82 | 600502 | 安徽水利 | 25,200 | 89,712.00 | 0.20 |
| 83 | 002303 | 美盈森 | 19,200 | 89,280.00 | 0.20 |
| 84 | 002585 | 双星新材 | 17,500 | 89,250.00 | 0.20 |
| 85 | 300523 | 辰安科技 | 1,500 | 89,250.00 | 0.20 |
| 86 | 600308 | 华泰股份 | 20,400 | 88,740.00 | 0.20 |
| 87 | 600285 | 羚锐制药 | 11,800 | 88,736.00 | 0.20 |
| 88 | 002643 | 万润股份 | 8,700 | 88,044.00 | 0.20 |
| 89 | 000555 | 神州信息 | 9,400 | 87,796.00 | 0.20 |
| 90 | 300339 | 润和软件 | 9,600 | 87,552.00 | 0.20 |
| 91 | 000666 | 经纬纺机 | 8,100 | 87,318.00 | 0.20 |
| 92 | 002429 | 兆驰股份 | 45,800 | 87,020.00 | 0.20 |
| 93 | 603660 | 苏州科达 | 5,200 | 86,684.00 | 0.20 |
| 94 | 300047 | 天源迪科 | 7,800 | 86,658.00 | 0.20 |
| 95 | 002550 | 千红制药 | 22,800 | 86,640.00 | 0.20 |
| 96 | 000910 | 大亚圣象 | 8,400 | 86,604.00 | 0.20 |
| 97 | 300369 | 绿盟科技 | 10,000 | 86,600.00 | 0.20 |
| 98 | 600966 | 博汇纸业 | 27,500 | 86,350.00 | 0.20 |
| 99 | 002484 | 江海股份 | 14,000 | 86,240.00 | 0.20 |
| 100 | 000672 | 上峰水泥 | 10,200 | 86,088.00 | 0.20 |
| 101 | 002031 | 巨轮智能 | 45,700 | 85,916.00 | 0.20 |
| 102 | 300476 | 胜宏科技 | 7,320 | 85,644.00 | 0.20 |
| 103 | 002327 | 富安娜 | 11,400 | 85,614.00 | 0.20 |
| 104 | 600422 | 昆药集团 | 13,800 | 85,284.00 | 0.19 |
| 105 | 002036 | 联创电子 | 9,900 | 85,140.00 | 0.19 |
| 106 | 002222 | 福晶科技 | 8,700 | 84,912.00 | 0.19 |
| 107 | 002343 | 慈文传媒 | 9,400 | 84,788.00 | 0.19 |
| 108 | 002206 | 海 利 得 | 22,200 | 84,582.00 | 0.19 |
| 109 | 601908 | 京运通 | 26,800 | 84,420.00 | 0.19 |
| 110 | 000751 | 锌业股份 | 29,500 | 84,075.00 | 0.19 |
| 111 | 601700 | 风范股份 | 22,000 | 84,040.00 | 0.19 |
| 112 | 600227 | 圣济堂 | 30,400 | 83,904.00 | 0.19 |
| 113 | 600059 | 古越龙山 | 12,700 | 83,820.00 | 0.19 |
| 114 | 600771 | 广誉远 | 2,900 | 83,723.00 | 0.19 |
| 115 | 600715 | 文投控股 | 18,600 | 83,700.00 | 0.19 |
| 116 | 600255 | 梦舟股份 | 46,500 | 83,700.00 | 0.19 |
| 117 | 002003 | 伟星股份 | 11,900 | 83,538.00 | 0.19 |
| 118 | 600063 | 皖维高新 | 35,800 | 83,414.00 | 0.19 |
| 119 | 002139 | 拓邦股份 | 21,200 | 83,104.00 | 0.19 |
| 120 | 002387 | 维信诺 | 10,900 | 83,058.00 | 0.19 |
| 121 | 600239 | 云南城投 | 28,800 | 82,944.00 | 0.19 |
| 122 | 000828 | 东莞控股 | 11,100 | 82,917.00 | 0.19 |
| 123 | 300219 | 鸿利智汇 | 10,800 | 82,728.00 | 0.19 |
| 124 | 601677 | 明泰铝业 | 9,400 | 82,626.00 | 0.19 |
| 125 | 603588 | 高能环境 | 10,500 | 82,425.00 | 0.19 |
| 126 | 002467 | 二六三 | 16,200 | 81,972.00 | 0.19 |
| 127 | 300323 | 华灿光电 | 11,300 | 81,699.00 | 0.19 |
| 128 | 300039 | 上海凯宝 | 20,100 | 81,606.00 | 0.19 |
| 129 | 002821 | 凯莱英 | 1,200 | 81,420.00 | 0.19 |
| 130 | 300232 | 洲明科技 | 8,500 | 81,090.00 | 0.18 |
| 131 | 300118 | 东方日升 | 14,200 | 80,798.00 | 0.18 |
| 132 | 603989 | 艾华集团 | 4,000 | 80,560.00 | 0.18 |
| 133 | 002626 | 金达威 | 6,700 | 80,534.00 | 0.18 |
| 134 | 000831 | 五矿稀土 | 9,600 | 80,352.00 | 0.18 |
| 135 | 002171 | 楚江新材 | 17,300 | 80,099.00 | 0.18 |
| 136 | 300045 | 华力创通 | 10,500 | 79,590.00 | 0.18 |
| 137 | 601101 | 昊华能源 | 13,200 | 79,332.00 | 0.18 |
| 138 | 600322 | 天房发展 | 24,400 | 79,300.00 | 0.18 |
| 139 | 002309 | 中利集团 | 9,500 | 79,230.00 | 0.18 |
| 140 | 300170 | 汉得信息 | 8,100 | 79,218.00 | 0.18 |
| 141 | 600363 | 联创光电 | 9,900 | 79,200.00 | 0.18 |
| 142 | 002649 | 博彦科技 | 10,800 | 79,164.00 | 0.18 |
| 143 | 002698 | 博实股份 | 8,900 | 79,121.00 | 0.18 |
| 144 | 600300 | 维维股份 | 28,000 | 78,960.00 | 0.18 |
| 145 | 000733 | 振华科技 | 7,200 | 78,768.00 | 0.18 |
| 146 | 002095 | 生 意 宝 | 4,000 | 78,720.00 | 0.18 |
| 147 | 600590 | 泰豪科技 | 14,600 | 78,694.00 | 0.18 |
| 148 | 002341 | 新纶科技 | 6,599 | 78,396.12 | 0.18 |
| 149 | 600114 | 东睦股份 | 12,500 | 78,375.00 | 0.18 |
| 150 | 600508 | 上海能源 | 8,100 | 78,165.00 | 0.18 |
| 151 | 300183 | 东软载波 | 6,600 | 77,682.00 | 0.18 |
| 152 | 300628 | 亿联网络 | 1,000 | 77,660.00 | 0.18 |
| 153 | 002501 | 利源精制 | 27,400 | 77,542.00 | 0.18 |
| 154 | 000735 | 罗 牛 山 | 8,000 | 77,280.00 | 0.18 |
| 155 | 300237 | 美晨生态 | 21,200 | 76,956.00 | 0.18 |
| 156 | 601163 | 三角轮胎 | 6,900 | 76,866.00 | 0.18 |
| 157 | 600211 | 西藏药业 | 2,600 | 76,726.00 | 0.17 |
| 158 | 002283 | 天润曲轴 | 22,900 | 76,715.00 | 0.17 |
| 159 | 600602 | 云赛智联 | 15,400 | 76,692.00 | 0.17 |
| 160 | 002531 | 天顺风能 | 17,200 | 76,540.00 | 0.17 |
| 161 | 000889 | 中嘉博创 | 7,500 | 76,500.00 | 0.17 |
| 162 | 000030 | 富奥股份 | 20,600 | 76,426.00 | 0.17 |
| 163 | 002055 | 得润电子 | 7,900 | 76,393.00 | 0.17 |
| 164 | 600075 | 新疆天业 | 16,900 | 76,388.00 | 0.17 |
| 165 | 600676 | 交运股份 | 17,700 | 76,287.00 | 0.17 |
| 166 | 002611 | 东方精工 | 20,300 | 76,125.00 | 0.17 |
| 167 | 601799 | 星宇股份 | 1,600 | 76,000.00 | 0.17 |
| 168 | 300438 | 鹏辉能源 | 4,700 | 75,952.00 | 0.17 |
| 169 | 300130 | 新国都 | 6,700 | 75,844.00 | 0.17 |
| 170 | 002240 | 威华股份 | 10,400 | 75,816.00 | 0.17 |
| 171 | 300336 | 新文化 | 17,200 | 75,680.00 | 0.17 |
| 172 | 603636 | 南威软件 | 7,800 | 74,880.00 | 0.17 |
| 173 | 601126 | 四方股份 | 14,700 | 74,823.00 | 0.17 |
| 174 | 000043 | 中航善达 | 10,000 | 74,800.00 | 0.17 |
| 175 | 002867 | 周大生 | 2,700 | 74,601.00 | 0.17 |
| 176 | 300388 | 国祯环保 | 8,400 | 74,340.00 | 0.17 |
| 177 | 002433 | 太安堂 | 15,800 | 74,102.00 | 0.17 |
| 178 | 002568 | 百润股份 | 8,100 | 74,034.00 | 0.17 |
| 179 | 300012 | 华测检测 | 11,300 | 74,015.00 | 0.17 |
| 180 | 002224 | 三 力 士 | 13,700 | 73,980.00 | 0.17 |
| 181 | 002279 | 久其软件 | 10,400 | 73,944.00 | 0.17 |
| 182 | 600326 | 西藏天路 | 11,400 | 73,872.00 | 0.17 |
| 183 | 601929 | 吉视传媒 | 36,000 | 73,800.00 | 0.17 |
| 184 | 601949 | 中国出版 | 16,800 | 73,752.00 | 0.17 |
| 185 | 600057 | 厦门象屿 | 17,600 | 73,568.00 | 0.17 |
| 186 | 000601 | 韶能股份 | 19,700 | 73,284.00 | 0.17 |
| 187 | 000301 | 东方盛虹 | 13,400 | 73,164.00 | 0.17 |
| 188 | 603118 | 共进股份 | 11,600 | 73,080.00 | 0.17 |
| 189 | 000973 | 佛塑科技 | 22,700 | 72,867.00 | 0.17 |
| 190 | 601666 | 平煤股份 | 20,600 | 72,512.00 | 0.17 |
| 191 | 600054 | 黄山旅游 | 7,700 | 72,226.00 | 0.16 |
| 192 | 603980 | 吉华集团 | 6,100 | 71,797.00 | 0.16 |
| 193 | 600012 | 皖通高速 | 11,900 | 71,757.00 | 0.16 |
| 194 | 002540 | 亚太科技 | 15,500 | 71,610.00 | 0.16 |
| 195 | 002060 | 粤 水 电 | 26,200 | 71,264.00 | 0.16 |
| 196 | 603108 | 润达医疗 | 9,900 | 71,181.00 | 0.16 |
| 197 | 002413 | 雷科防务 | 13,300 | 71,155.00 | 0.16 |
| 198 | 002182 | 云海金属 | 11,400 | 71,136.00 | 0.16 |
| 199 | 300233 | 金城医药 | 5,200 | 70,980.00 | 0.16 |
| 200 | 600103 | 青山纸业 | 27,700 | 70,912.00 | 0.16 |
| 201 | 603939 | 益丰药房 | 1,700 | 70,890.00 | 0.16 |
| 202 | 000055 | 方大集团 | 17,700 | 70,800.00 | 0.16 |
| 203 | 600995 | 文山电力 | 10,700 | 70,727.00 | 0.16 |
| 204 | 000065 | 北方国际 | 9,200 | 70,656.00 | 0.16 |
| 205 | 300007 | 汉威科技 | 7,200 | 70,632.00 | 0.16 |
| 206 | 000545 | 金浦钛业 | 22,500 | 70,425.00 | 0.16 |
| 207 | 000968 | 蓝焰控股 | 6,600 | 70,290.00 | 0.16 |
| 208 | 603393 | 新天然气 | 2,300 | 70,150.00 | 0.16 |
| 209 | 600129 | 太极集团 | 8,400 | 70,140.00 | 0.16 |
| 210 | 603808 | 歌力思 | 4,300 | 69,832.00 | 0.16 |
| 211 | 603298 | 杭叉集团 | 5,900 | 69,738.00 | 0.16 |
| 212 | 002539 | 云图控股 | 17,000 | 69,700.00 | 0.16 |
| 213 | 000592 | 平潭发展 | 26,100 | 69,687.00 | 0.16 |
| 214 | 000965 | 天保基建 | 18,100 | 69,685.00 | 0.16 |
| 215 | 603979 | 金诚信 | 9,300 | 69,657.00 | 0.16 |
| 216 | 002648 | 卫星石化 | 7,200 | 69,624.00 | 0.16 |
| 217 | 600449 | 宁夏建材 | 9,400 | 69,278.00 | 0.16 |
| 218 | 300203 | 聚光科技 | 2,700 | 69,255.00 | 0.16 |
| 219 | 300303 | 聚飞光电 | 28,400 | 69,012.00 | 0.16 |
| 220 | 000070 | 特发信息 | 9,700 | 68,870.00 | 0.16 |
| 221 | 600480 | 凌云股份 | 9,000 | 68,670.00 | 0.16 |
| 222 | 600467 | 好当家 | 28,600 | 68,640.00 | 0.16 |
| 223 | 002481 | 双塔食品 | 24,500 | 68,600.00 | 0.16 |
| 224 | 600668 | 尖峰集团 | 5,800 | 68,440.00 | 0.16 |
| 225 | 600596 | 新安股份 | 6,400 | 68,416.00 | 0.16 |
| 226 | 600720 | 祁连山 | 10,600 | 68,370.00 | 0.16 |
| 227 | 603367 | 辰欣药业 | 4,500 | 68,310.00 | 0.16 |
| 228 | 600035 | 楚天高速 | 23,100 | 68,145.00 | 0.16 |
| 229 | 300009 | 安科生物 | 5,100 | 68,136.00 | 0.16 |
| 230 | 600559 | 老白干酒 | 5,500 | 67,980.00 | 0.16 |
| 231 | 002756 | 永兴特钢 | 5,700 | 67,944.00 | 0.15 |
| 232 | 600382 | 广东明珠 | 8,800 | 67,936.00 | 0.15 |
| 233 | 603920 | 世运电路 | 5,700 | 67,887.00 | 0.15 |
| 234 | 002068 | 黑猫股份 | 11,500 | 67,850.00 | 0.15 |
| 235 | 600686 | 金龙汽车 | 9,900 | 67,815.00 | 0.15 |
| 236 | 300366 | 创意信息 | 9,200 | 67,344.00 | 0.15 |
| 237 | 603003 | 龙宇燃油 | 10,000 | 67,300.00 | 0.15 |
| 238 | 002247 | 聚力文化 | 14,400 | 67,104.00 | 0.15 |
| 239 | 601599 | 鹿港文化 | 21,500 | 67,080.00 | 0.15 |
| 240 | 300184 | 力源信息 | 8,800 | 66,968.00 | 0.15 |
| 241 | 000544 | 中原环保 | 13,200 | 66,924.00 | 0.15 |
| 242 | 300205 | 天喻信息 | 8,200 | 66,748.00 | 0.15 |
| 243 | 002393 | 力生制药 | 3,100 | 66,743.00 | 0.15 |
| 244 | 603609 | 禾丰牧业 | 8,600 | 66,650.00 | 0.15 |
| 245 | 601369 | 陕鼓动力 | 11,000 | 66,550.00 | 0.15 |
| 246 | 300083 | 劲胜智能 | 28,100 | 66,316.00 | 0.15 |
| 247 | 002168 | 惠程科技 | 6,700 | 66,263.00 | 0.15 |
| 248 | 603345 | 安井食品 | 1,800 | 66,240.00 | 0.15 |
| 249 | 603599 | 广信股份 | 6,300 | 66,150.00 | 0.15 |
| 250 | 603898 | 好莱客 | 4,300 | 65,919.00 | 0.15 |
| 251 | 300255 | 常山药业 | 16,100 | 65,849.00 | 0.15 |
| 252 | 000040 | 东旭蓝天 | 9,100 | 65,793.00 | 0.15 |
| 253 | 002727 | 一心堂 | 3,700 | 65,786.00 | 0.15 |
| 254 | 002033 | 丽江旅游 | 11,600 | 65,772.00 | 0.15 |
| 255 | 300485 | 赛升药业 | 6,700 | 65,727.00 | 0.15 |
| 256 | 000404 | 长虹华意 | 17,000 | 65,620.00 | 0.15 |
| 257 | 600533 | 栖霞建设 | 22,300 | 65,562.00 | 0.15 |
| 258 | 002079 | 苏州固锝 | 14,000 | 65,380.00 | 0.15 |
| 259 | 002705 | 新宝股份 | 7,100 | 65,178.00 | 0.15 |
| 260 | 300363 | 博腾股份 | 7,300 | 64,678.00 | 0.15 |
| 261 | 603008 | 喜临门 | 7,000 | 64,540.00 | 0.15 |
| 262 | 300145 | 中金环境 | 19,800 | 64,350.00 | 0.15 |
| 263 | 600650 | 锦江投资 | 6,800 | 64,260.00 | 0.15 |
| 264 | 600985 | 淮北矿业 | 6,900 | 64,170.00 | 0.15 |
| 265 | 300377 | 赢时胜 | 5,800 | 64,032.00 | 0.15 |
| 266 | 601900 | 南方传媒 | 7,600 | 63,992.00 | 0.15 |
| 267 | 300304 | 云意电气 | 18,700 | 63,954.00 | 0.15 |
| 268 | 000516 | 国际医学 | 12,900 | 63,855.00 | 0.15 |
| 269 | 002609 | 捷顺科技 | 11,500 | 63,710.00 | 0.15 |
| 270 | 600162 | 香江控股 | 29,200 | 63,656.00 | 0.15 |
| 271 | 002322 | 理工环科 | 7,000 | 63,560.00 | 0.14 |
| 272 | 002318 | 久立特材 | 10,000 | 63,400.00 | 0.14 |
| 273 | 600616 | 金枫酒业 | 13,300 | 63,308.00 | 0.14 |
| 274 | 300191 | 潜能恒信 | 4,300 | 63,296.00 | 0.14 |
| 275 | 600997 | 开滦股份 | 11,100 | 62,937.00 | 0.14 |
| 276 | 600273 | 嘉化能源 | 7,000 | 62,930.00 | 0.14 |
| 277 | 002772 | 众兴菌业 | 9,700 | 62,759.00 | 0.14 |
| 278 | 300212 | 易华录 | 3,000 | 62,160.00 | 0.14 |
| 279 | 300465 | 高伟达 | 10,300 | 61,903.00 | 0.14 |
| 280 | 300276 | 三丰智能 | 6,000 | 61,860.00 | 0.14 |
| 281 | 002430 | 杭氧股份 | 6,600 | 61,710.00 | 0.14 |
| 282 | 300307 | 慈星股份 | 12,900 | 61,662.00 | 0.14 |
| 283 | 300172 | 中电环保 | 11,800 | 61,596.00 | 0.14 |
| 284 | 000958 | 东方能源 | 19,100 | 61,502.00 | 0.14 |
| 285 | 002329 | 皇氏集团 | 18,900 | 61,425.00 | 0.14 |
| 286 | 600501 | 航天晨光 | 10,100 | 61,307.00 | 0.14 |
| 287 | 300309 | 吉艾科技 | 7,600 | 61,256.00 | 0.14 |
| 288 | 002097 | 山河智能 | 11,000 | 61,050.00 | 0.14 |
| 289 | 600512 | 腾达建设 | 28,200 | 60,630.00 | 0.14 |
| 290 | 000710 | 贝瑞基因 | 1,900 | 60,610.00 | 0.14 |
| 291 | 300194 | 福安药业 | 18,800 | 60,348.00 | 0.14 |
| 292 | 002872 | 天圣制药 | 7,000 | 59,920.00 | 0.14 |
| 293 | 603803 | 瑞斯康达 | 5,900 | 59,767.00 | 0.14 |
| 294 | 002232 | 启明信息 | 8,800 | 59,752.00 | 0.14 |
| 295 | 000700 | 模塑科技 | 20,200 | 59,590.00 | 0.14 |
| 296 | 002246 | 北化股份 | 9,000 | 59,490.00 | 0.14 |
| 297 | 002401 | 中远海科 | 6,600 | 59,202.00 | 0.14 |
| 298 | 002712 | 思美传媒 | 9,900 | 59,103.00 | 0.13 |
| 299 | 002685 | 华东重机 | 12,000 | 59,040.00 | 0.13 |
| 300 | 000885 | 城发环境 | 8,200 | 58,794.00 | 0.13 |
| 301 | 601595 | 上海电影 | 4,800 | 58,704.00 | 0.13 |
| 302 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,900 | 58,387.00 | 0.13 |
| 303 | 300073 | 当升科技 | 2,100 | 58,149.00 | 0.13 |
| 304 | 002605 | 姚记扑克 | 7,700 | 57,827.00 | 0.13 |
| 305 | 300378 | 鼎捷软件 | 5,900 | 57,761.00 | 0.13 |
| 306 | 002104 | 恒宝股份 | 9,800 | 57,428.00 | 0.13 |
| 307 | 300528 | 幸福蓝海 | 6,800 | 57,120.00 | 0.13 |
| 308 | 300533 | 冰川网络 | 1,800 | 56,862.00 | 0.13 |
| 309 | 002788 | 鹭燕医药 | 4,500 | 56,790.00 | 0.13 |
| 310 | 300468 | 四方精创 | 4,700 | 56,635.00 | 0.13 |
| 311 | 002135 | 东南网架 | 11,400 | 56,544.00 | 0.13 |
| 312 | 002675 | 东诚药业 | 7,100 | 55,877.00 | 0.13 |
| 313 | 603612 | 索通发展 | 4,800 | 55,872.00 | 0.13 |
| 314 | 002521 | 齐峰新材 | 10,000 | 55,700.00 | 0.13 |
| 315 | 603385 | 惠达卫浴 | 6,900 | 55,269.00 | 0.13 |
| 316 | 603801 | 志邦家居 | 2,300 | 55,223.00 | 0.13 |
| 317 | 300511 | 雪榕生物 | 9,200 | 54,924.00 | 0.13 |
| 318 | 300061 | 康旗股份 | 9,200 | 54,740.00 | 0.12 |
| 319 | 002530 | 金财互联 | 8,300 | 54,697.00 | 0.12 |
| 320 | 000797 | 中国武夷 | 12,000 | 54,600.00 | 0.12 |
| 321 | 002071 | 长城影视 | 12,000 | 54,600.00 | 0.12 |
| 322 | 002812 | 恩捷股份 | 1,100 | 54,351.00 | 0.12 |
| 323 | 600261 | 阳光照明 | 15,800 | 53,878.00 | 0.12 |
| 324 | 603113 | 金能科技 | 4,900 | 53,753.00 | 0.12 |
| 325 | 000731 | 四川美丰 | 10,700 | 53,714.00 | 0.12 |
| 326 | 002185 | 华天科技 | 13,000 | 52,780.00 | 0.12 |
| 327 | 300467 | 迅游科技 | 2,300 | 52,739.00 | 0.12 |
| 328 | 600798 | 宁波海运 | 16,300 | 52,649.00 | 0.12 |
| 329 | 603358 | 华达科技 | 4,860 | 52,245.00 | 0.12 |
| 330 | 300160 | 秀强股份 | 15,100 | 52,095.00 | 0.12 |
| 331 | 002245 | 澳洋顺昌 | 13,100 | 50,828.00 | 0.12 |
| 332 | 300014 | 亿纬锂能 | 3,200 | 50,304.00 | 0.11 |
| 333 | 603277 | 银都股份 | 5,600 | 49,056.00 | 0.11 |
| 334 | 300065 | 海兰信 | 4,700 | 48,034.00 | 0.11 |
| 335 | 000631 | 顺发恒业 | 16,000 | 47,520.00 | 0.11 |
| 336 | 000701 | 厦门信达 | 7,800 | 47,268.00 | 0.11 |
| 337 | 000818 | 航锦科技 | 5,100 | 47,073.00 | 0.11 |
| 338 | 600571 | 信雅达 | 7,400 | 46,620.00 | 0.11 |
| 339 | 600231 | 凌钢股份 | 17,300 | 46,191.00 | 0.11 |
| 340 | 002737 | 葵花药业 | 3,100 | 45,818.00 | 0.10 |
| 341 | 603678 | 火炬电子 | 2,900 | 45,733.00 | 0.10 |
| 342 | 000881 | 中广核技 | 6,800 | 45,696.00 | 0.10 |
| 343 | 600702 | 舍得酒业 | 2,000 | 45,640.00 | 0.10 |
| 344 | 600096 | 云天化 | 9,100 | 45,591.00 | 0.10 |
| 345 | 300066 | 三川智慧 | 13,700 | 45,484.00 | 0.10 |
| 346 | 002538 | 司尔特 | 9,400 | 45,402.00 | 0.10 |
| 347 | 002335 | 科华恒盛 | 3,000 | 45,210.00 | 0.10 |
| 348 | 002746 | 仙坛股份 | 3,300 | 45,144.00 | 0.10 |
| 349 | 002035 | 华帝股份 | 5,100 | 45,135.00 | 0.10 |
| 350 | 002537 | 海联金汇 | 4,400 | 45,100.00 | 0.10 |
| 351 | 603338 | 浙江鼎力 | 800 | 45,056.00 | 0.10 |
| 352 | 600661 | 昂立教育 | 2,300 | 44,988.00 | 0.10 |
| 353 | 300558 | 贝达药业 | 1,400 | 44,758.00 | 0.10 |
| 354 | 300180 | 华峰超纤 | 4,000 | 44,600.00 | 0.10 |
| 355 | 000815 | 美利云 | 6,600 | 44,550.00 | 0.10 |
| 356 | 601011 | 宝泰隆 | 8,100 | 44,550.00 | 0.10 |
| 357 | 603686 | 龙马环卫 | 4,100 | 44,526.00 | 0.10 |
| 358 | 600641 | 万业企业 | 4,900 | 44,492.00 | 0.10 |
| 359 | 300048 | 合康新能 | 18,600 | 44,454.00 | 0.10 |
| 360 | 000837 | 秦川机床 | 11,200 | 44,016.00 | 0.10 |
| 361 | 300054 | 鼎龙股份 | 6,900 | 43,953.00 | 0.10 |
| 362 | 603618 | 杭电股份 | 8,400 | 43,848.00 | 0.10 |
| 363 | 000957 | 中通客车 | 9,800 | 43,610.00 | 0.10 |
| 364 | 300531 | 优博讯 | 2,600 | 43,602.00 | 0.10 |
| 365 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 7,800 | 43,602.00 | 0.10 |
| 366 | 002178 | 延华智能 | 11,800 | 43,306.00 | 0.10 |
| 367 | 002382 | 蓝帆医疗 | 2,900 | 43,094.00 | 0.10 |
| 368 | 300188 | 美亚柏科 | 3,300 | 42,966.00 | 0.10 |
| 369 | 002157 | 正邦科技 | 8,000 | 42,480.00 | 0.10 |
| 370 | 300463 | 迈克生物 | 2,900 | 42,340.00 | 0.10 |
| 371 | 002130 | 沃尔核材 | 13,000 | 42,120.00 | 0.10 |
| 372 | 603313 | 梦百合 | 2,000 | 42,020.00 | 0.10 |
| 373 | 600742 | 一汽富维 | 4,200 | 41,916.00 | 0.10 |
| 374 | 300349 | 金卡智能 | 2,600 | 41,860.00 | 0.10 |
| 375 | 601636 | 旗滨集团 | 11,000 | 41,800.00 | 0.10 |
| 376 | 300053 | 欧比特 | 5,100 | 41,616.00 | 0.09 |
| 377 | 300439 | 美康生物 | 3,100 | 41,416.00 | 0.09 |
| 378 | 002023 | 海特高新 | 4,000 | 41,400.00 | 0.09 |
| 379 | 300114 | 中航电测 | 5,800 | 41,296.00 | 0.09 |
| 380 | 300068 | 南都电源 | 2,900 | 41,238.00 | 0.09 |
| 381 | 002061 | 浙江交科 | 4,000 | 41,080.00 | 0.09 |
| 382 | 000603 | 盛达矿业 | 4,100 | 41,000.00 | 0.09 |
| 383 | 002590 | 万安科技 | 6,300 | 40,068.00 | 0.09 |
| 384 | 000971 | 高升控股 | 12,000 | 39,840.00 | 0.09 |
| 385 | 600986 | 科达股份 | 9,500 | 39,805.00 | 0.09 |
| 386 | 600622 | 光大嘉宝 | 7,000 | 39,690.00 | 0.09 |
| 387 | 002436 | 兴森科技 | 8,700 | 39,324.00 | 0.09 |
| 388 | 000795 | 英洛华 | 11,000 | 39,270.00 | 0.09 |
| 389 | 600477 | 杭萧钢构 | 10,900 | 39,240.00 | 0.09 |
| 390 | 002234 | 民和股份 | 3,400 | 38,930.00 | 0.09 |
| 391 | 600626 | 申达股份 | 7,800 | 38,532.00 | 0.09 |
| 392 | 603218 | 日月股份 | 2,300 | 37,996.00 | 0.09 |
| 393 | 002215 | 诺 普 信 | 5,400 | 36,504.00 | 0.08 |
| 394 | 300512 | 中亚股份 | 3,000 | 36,000.00 | 0.08 |
| 395 | 600764 | 中国海防 | 1,500 | 35,760.00 | 0.08 |
| 396 | 600846 | 同济科技 | 5,000 | 35,750.00 | 0.08 |
| 397 | 002906 | 华阳集团 | 3,600 | 35,136.00 | 0.08 |
| 398 | 300078 | 思创医惠 | 3,500 | 34,790.00 | 0.08 |
| 399 | 000918 | 嘉凯城 | 4,500 | 34,290.00 | 0.08 |
| 400 | 603839 | 安正时尚 | 3,200 | 34,240.00 | 0.08 |
| 401 | 002511 | 中顺洁柔 | 4,000 | 34,080.00 | 0.08 |
| 402 | 000800 | 一汽轿车 | 5,100 | 33,762.00 | 0.08 |
| 403 | 300037 | 新宙邦 | 1,400 | 33,670.00 | 0.08 |
| 404 | 600756 | 浪潮软件 | 2,200 | 33,638.00 | 0.08 |
| 405 | 002047 | 宝鹰股份 | 4,900 | 33,565.00 | 0.08 |
| 406 | 300496 | 中科创达 | 1,500 | 33,150.00 | 0.08 |
| 407 | 603817 | 海峡环保 | 5,500 | 33,055.00 | 0.08 |
| 408 | 603339 | 四方科技 | 2,200 | 32,890.00 | 0.08 |
| 409 | 600093 | 易见股份 | 4,300 | 32,594.00 | 0.07 |
| 410 | 300451 | 创业慧康 | 1,700 | 32,555.00 | 0.07 |
| 411 | 300222 | 科大智能 | 2,100 | 32,550.00 | 0.07 |
| 412 | 000851 | 高鸿股份 | 6,800 | 32,368.00 | 0.07 |
| 413 | 600529 | 山东药玻 | 1,700 | 32,300.00 | 0.07 |
| 414 | 002618 | 丹邦科技 | 2,300 | 31,671.00 | 0.07 |
| 415 | 600612 | 老凤祥 | 700 | 31,500.00 | 0.07 |
| 416 | 300326 | 凯利泰 | 3,700 | 31,450.00 | 0.07 |
| 417 | 300365 | 恒华科技 | 1,500 | 31,350.00 | 0.07 |
| 418 | 600020 | 中原高速 | 8,510 | 31,231.70 | 0.07 |
| 419 | 600868 | 梅雁吉祥 | 10,900 | 31,065.00 | 0.07 |
| 420 | 002421 | 达实智能 | 7,800 | 30,576.00 | 0.07 |
| 421 | 002597 | 金禾实业 | 1,900 | 30,191.00 | 0.07 |
| 422 | 600456 | 宝钛股份 | 2,000 | 30,180.00 | 0.07 |
| 423 | 000921 | 海信家电 | 4,200 | 29,694.00 | 0.07 |
| 424 | 300357 | 我武生物 | 800 | 29,592.00 | 0.07 |
| 425 | 601222 | 林洋能源 | 6,100 | 29,524.00 | 0.07 |
| 426 | 600604 | 市北高新 | 3,800 | 29,298.00 | 0.07 |
| 427 | 300529 | 健帆生物 | 700 | 29,050.00 | 0.07 |
| 428 | 300097 | 智云股份 | 2,600 | 29,042.00 | 0.07 |
| 429 | 300177 | 中海达 | 2,800 | 28,644.00 | 0.07 |
| 430 | 300355 | 蒙草生态 | 7,300 | 28,397.00 | 0.06 |
| 431 | 000951 | 中国重汽 | 2,545 | 28,351.30 | 0.06 |
| 432 | 300457 | 赢合科技 | 1,000 | 27,850.00 | 0.06 |
| 433 | 300149 | 量子生物 | 1,900 | 27,797.00 | 0.06 |
| 434 | 600360 | 华微电子 | 5,400 | 27,756.00 | 0.06 |
| 435 | 600446 | 金证股份 | 2,900 | 27,550.00 | 0.06 |
| 436 | 000739 | 普洛药业 | 3,700 | 27,528.00 | 0.06 |
| 437 | 600279 | 重庆港九 | 6,900 | 26,979.00 | 0.06 |
| 438 | 002298 | 中电兴发 | 4,500 | 26,550.00 | 0.06 |
| 439 | 002462 | 嘉事堂 | 1,800 | 26,010.00 | 0.06 |
| 440 | 600531 | 豫光金铅 | 7,400 | 25,826.00 | 0.06 |
| 441 | 600569 | 安阳钢铁 | 8,500 | 25,755.00 | 0.06 |
| 442 | 002261 | 拓维信息 | 6,100 | 25,742.00 | 0.06 |
| 443 | 603299 | 苏盐井神 | 5,000 | 25,650.00 | 0.06 |
| 444 | 600185 | 格力地产 | 6,300 | 25,515.00 | 0.06 |
| 445 | 601388 | 怡球资源 | 13,100 | 25,283.00 | 0.06 |
| 446 | 002089 | 新 海 宜 | 5,800 | 24,940.00 | 0.06 |
| 447 | 600568 | 中珠医疗 | 10,800 | 24,624.00 | 0.06 |
| 448 | 002630 | 华西能源 | 8,600 | 24,510.00 | 0.06 |
| 449 | 002389 | 航天彩虹 | 2,000 | 24,420.00 | 0.06 |
| 450 | 300616 | 尚品宅配 | 400 | 24,308.00 | 0.06 |
| 451 | 002314 | 南山控股 | 8,400 | 24,108.00 | 0.05 |
| 452 | 002239 | 奥特佳 | 12,000 | 24,000.00 | 0.05 |
| 453 | 002488 | 金固股份 | 3,600 | 23,868.00 | 0.05 |
| 454 | 002833 | 弘亚数控 | 700 | 23,800.00 | 0.05 |
| 455 | 300016 | 北陆药业 | 3,400 | 23,800.00 | 0.05 |
| 456 | 002253 | 川大智胜 | 1,800 | 23,796.00 | 0.05 |
| 457 | 600707 | 彩虹股份 | 5,700 | 23,541.00 | 0.05 |
| 458 | 300157 | 恒泰艾普 | 5,600 | 23,240.00 | 0.05 |
| 459 | 600740 | 山西焦化 | 2,900 | 23,229.00 | 0.05 |
| 460 | 002554 | 惠博普 | 8,500 | 23,035.00 | 0.05 |
| 461 | 300079 | 数码科技 | 7,000 | 23,030.00 | 0.05 |
| 462 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,200 | 22,880.00 | 0.05 |
| 463 | 300123 | 亚光科技 | 2,500 | 22,825.00 | 0.05 |
| 464 | 600110 | 诺德股份 | 5,600 | 22,736.00 | 0.05 |
| 465 | 002313 | 日海智能 | 1,000 | 22,580.00 | 0.05 |
| 466 | 002497 | 雅化集团 | 3,400 | 22,576.00 | 0.05 |
| 467 | 002582 | 好想你 | 3,000 | 22,560.00 | 0.05 |
| 468 | 300158 | 振东制药 | 5,900 | 22,479.00 | 0.05 |
| 469 | 603308 | 应流股份 | 2,800 | 22,456.00 | 0.05 |
| 470 | 002516 | 旷达科技 | 7,900 | 22,436.00 | 0.05 |
| 471 | 601918 | 新集能源 | 7,400 | 22,274.00 | 0.05 |
| 472 | 002409 | 雅克科技 | 1,600 | 22,192.00 | 0.05 |
| 473 | 300332 | 天壕环境 | 6,000 | 22,140.00 | 0.05 |
| 474 | 300311 | 任子行 | 3,800 | 22,078.00 | 0.05 |
| 475 | 300458 | 全志科技 | 1,100 | 22,000.00 | 0.05 |
| 476 | 600783 | 鲁信创投 | 1,400 | 21,952.00 | 0.05 |
| 477 | 002086 | 东方海洋 | 5,000 | 21,800.00 | 0.05 |
| 478 | 300215 | 电科院 | 4,100 | 21,730.00 | 0.05 |
| 479 | 601375 | 中原证券 | 5,100 | 21,726.00 | 0.05 |
| 480 | 000811 | 冰轮环境 | 4,200 | 21,714.00 | 0.05 |
| 481 | 002196 | 方正电机 | 4,200 | 21,294.00 | 0.05 |
| 482 | 300367 | 东方网力 | 2,400 | 21,288.00 | 0.05 |
| 483 | 300137 | 先河环保 | 2,600 | 21,190.00 | 0.05 |
| 484 | 603323 | 吴江银行 | 3,460 | 21,140.60 | 0.05 |
| 485 | 601789 | 宁波建工 | 6,800 | 21,080.00 | 0.05 |
| 486 | 300359 | 全通教育 | 3,600 | 21,060.00 | 0.05 |
| 487 | 002557 | 洽洽食品 | 1,100 | 20,944.00 | 0.05 |
| 488 | 300424 | 航新科技 | 1,500 | 20,910.00 | 0.05 |
| 489 | 002166 | 莱茵生物 | 3,400 | 20,876.00 | 0.05 |
| 490 | 600855 | 航天长峰 | 2,300 | 20,769.00 | 0.05 |
| 491 | 600226 | 瀚叶股份 | 7,400 | 20,720.00 | 0.05 |
| 492 | 300077 | 国民技术 | 2,800 | 20,692.00 | 0.05 |
| 493 | 000933 | 神火股份 | 5,300 | 20,670.00 | 0.05 |
| 494 | 002631 | 德尔未来 | 3,200 | 20,608.00 | 0.05 |
| 495 | 601137 | 博威合金 | 3,000 | 20,460.00 | 0.05 |
| 496 | 002203 | 海亮股份 | 2,600 | 20,436.00 | 0.05 |
| 497 | 300482 | 万孚生物 | 800 | 20,328.00 | 0.05 |
| 498 | 002237 | 恒邦股份 | 2,400 | 20,112.00 | 0.05 |
| 499 | 603508 | 思维列控 | 500 | 19,905.00 | 0.05 |
| 500 | 600116 | 三峡水利 | 2,700 | 19,764.00 | 0.05 |
| 501 | 600210 | 紫江企业 | 5,400 | 19,656.00 | 0.04 |
| 502 | 300328 | 宜安科技 | 3,200 | 19,648.00 | 0.04 |
| 503 | 001896 | 豫能控股 | 6,400 | 19,520.00 | 0.04 |
| 504 | 002534 | 杭锅股份 | 3,600 | 19,260.00 | 0.04 |
| 505 | 300660 | 江苏雷利 | 1,000 | 19,220.00 | 0.04 |
| 506 | 603900 | 莱绅通灵 | 1,600 | 19,056.00 | 0.04 |
| 507 | 000507 | 珠海港 | 2,800 | 18,480.00 | 0.04 |
| 508 | 600667 | 太极实业 | 3,600 | 18,396.00 | 0.04 |
| 509 | 002108 | 沧州明珠 | 4,200 | 17,682.00 | 0.04 |
| 510 | 000989 | 九 芝 堂 | 1,800 | 17,658.00 | 0.04 |
| 511 | 000429 | 粤高速Ａ | 2,100 | 17,619.00 | 0.04 |
| 512 | 002091 | 江苏国泰 | 3,100 | 17,360.00 | 0.04 |
| 513 | 600200 | 江苏吴中 | 2,900 | 17,168.00 | 0.04 |
| 514 | 600173 | 卧龙地产 | 4,500 | 16,965.00 | 0.04 |
| 515 | 300102 | 乾照光电 | 2,900 | 16,907.00 | 0.04 |
| 516 | 601882 | 海天精工 | 2,400 | 16,896.00 | 0.04 |
| 517 | 300447 | 全信股份 | 1,800 | 16,704.00 | 0.04 |
| 518 | 002156 | 通富微电 | 2,300 | 16,399.00 | 0.04 |
| 519 | 600230 | 沧州大化 | 1,000 | 16,150.00 | 0.04 |
| 520 | 601015 | 陕西黑猫 | 3,000 | 15,930.00 | 0.04 |
| 521 | 000035 | 中国天楹 | 3,000 | 15,600.00 | 0.04 |
| 522 | 600108 | 亚盛集团 | 5,900 | 15,576.00 | 0.04 |
| 523 | 603718 | 海利生物 | 1,200 | 15,192.00 | 0.03 |
| 524 | 600988 | 赤峰黄金 | 3,800 | 15,162.00 | 0.03 |
| 525 | 300567 | 精测电子 | 300 | 15,144.00 | 0.03 |
| 526 | 300618 | 寒锐钴业 | 200 | 14,816.00 | 0.03 |
| 527 | 002716 | 金贵银业 | 2,400 | 14,712.00 | 0.03 |
| 528 | 300699 | 光威复材 | 400 | 14,320.00 | 0.03 |
| 529 | 600206 | 有研新材 | 2,100 | 13,713.00 | 0.03 |
| 530 | 603043 | 广州酒家 | 500 | 13,540.00 | 0.03 |
| 531 | 300495 | 美尚生态 | 1,000 | 13,200.00 | 0.03 |
| 532 | 002219 | 恒康医疗 | 3,800 | 13,072.00 | 0.03 |
| 533 | 002067 | 景兴纸业 | 3,700 | 12,987.00 | 0.03 |
| 534 | 002364 | 中恒电气 | 1,100 | 12,936.00 | 0.03 |
| 535 | 600789 | 鲁抗医药 | 1,700 | 12,835.00 | 0.03 |
| 536 | 002510 | 天汽模 | 3,500 | 12,565.00 | 0.03 |
| 537 | 000088 | 盐 田 港 | 2,500 | 12,500.00 | 0.03 |
| 538 | 600400 | 红豆股份 | 3,200 | 12,000.00 | 0.03 |
| 539 | 600856 | 中天能源 | 3,200 | 11,904.00 | 0.03 |
| 540 | 300101 | 振芯科技 | 1,200 | 11,880.00 | 0.03 |
| 541 | 002574 | 明牌珠宝 | 2,400 | 11,832.00 | 0.03 |
| 542 | 002502 | 骅威文化 | 2,900 | 11,426.00 | 0.03 |
| 543 | 600621 | 华鑫股份 | 1,300 | 11,414.00 | 0.03 |
| 544 | 002596 | 海南瑞泽 | 1,900 | 11,381.00 | 0.03 |
| 545 | 300516 | 久之洋 | 400 | 11,008.00 | 0.03 |
| 546 | 603303 | 得邦照明 | 900 | 10,665.00 | 0.02 |
| 547 | 601069 | 西部黄金 | 700 | 10,409.00 | 0.02 |
| 548 | 000869 | 张 裕Ａ | 400 | 10,400.00 | 0.02 |
| 549 | 002124 | 天邦股份 | 1,500 | 10,200.00 | 0.02 |
| 550 | 002258 | 利尔化学 | 700 | 9,198.00 | 0.02 |
| 551 | 000882 | 华联股份 | 4,100 | 9,143.00 | 0.02 |
| 552 | 000935 | 四川双马 | 600 | 9,024.00 | 0.02 |
| 553 | 600391 | 航发科技 | 800 | 8,744.00 | 0.02 |
| 554 | 002117 | 东港股份 | 600 | 8,490.00 | 0.02 |
| 555 | 300666 | 江丰电子 | 200 | 8,264.00 | 0.02 |
| 556 | 600495 | 晋西车轴 | 2,000 | 8,220.00 | 0.02 |
| 557 | 600076 | 康欣新材 | 2,000 | 8,200.00 | 0.02 |
| 558 | 600217 | 中再资环 | 2,000 | 8,180.00 | 0.02 |
| 559 | 002192 | 融捷股份 | 400 | 7,296.00 | 0.02 |
| 560 | 300292 | 吴通控股 | 1,900 | 7,258.00 | 0.02 |
| 561 | 002326 | 永太科技 | 1,000 | 6,990.00 | 0.02 |
| 562 | 600990 | 四创电子 | 200 | 6,858.00 | 0.02 |
| 563 | 002370 | 亚太药业 | 400 | 6,644.00 | 0.02 |
| 564 | 600197 | 伊力特 | 500 | 6,515.00 | 0.01 |
| 565 | 002256 | 兆新股份 | 2,200 | 6,490.00 | 0.01 |
| 566 | 600105 | 永鼎股份 | 1,600 | 6,176.00 | 0.01 |
| 567 | 002859 | 洁美科技 | 200 | 6,150.00 | 0.01 |
| 568 | 603357 | 设计总院 | 300 | 5,985.00 | 0.01 |
| 569 | 300379 | 东方通 | 400 | 5,620.00 | 0.01 |
| 570 | 002668 | 奥马电器 | 1,100 | 5,357.00 | 0.01 |
| 571 | 002425 | 凯撒文化 | 900 | 5,292.00 | 0.01 |
| 572 | 002547 | 春兴精工 | 1,000 | 5,290.00 | 0.01 |
| 573 | 300352 | 北信源 | 1,400 | 4,606.00 | 0.01 |
| 574 | 300178 | 腾邦国际 | 500 | 4,520.00 | 0.01 |
| 575 | 300568 | 星源材质 | 200 | 4,438.00 | 0.01 |
| 576 | 002267 | 陕天然气 | 600 | 4,434.00 | 0.01 |
| 577 | 600812 | 华北制药 | 1,100 | 4,400.00 | 0.01 |
| 578 | 300075 | 数字政通 | 400 | 4,360.00 | 0.01 |
| 579 | 000687 | 华讯方舟 | 600 | 4,260.00 | 0.01 |
| 580 | 603128 | 华贸物流 | 800 | 4,256.00 | 0.01 |
| 581 | 002080 | 中材科技 | 500 | 4,045.00 | 0.01 |
| 582 | 300595 | 欧普康视 | 100 | 3,874.00 | 0.01 |
| 583 | 600677 | 航天通信 | 400 | 3,788.00 | 0.01 |
| 584 | 603337 | 杰克股份 | 100 | 3,669.00 | 0.01 |
| 585 | 600172 | 黄河旋风 | 1,200 | 3,660.00 | 0.01 |
| 586 | 002284 | 亚太股份 | 800 | 3,400.00 | 0.01 |
| 587 | 300429 | 强力新材 | 100 | 3,120.00 | 0.01 |
| 588 | 000936 | 华西股份 | 500 | 3,060.00 | 0.01 |
| 589 | 000525 | 红 太 阳 | 200 | 2,806.00 | 0.01 |
| 590 | 300031 | 宝通科技 | 200 | 2,638.00 | 0.01 |
| 591 | 300409 | 道氏技术 | 200 | 2,622.00 | 0.01 |
| 592 | 002321 | 华英农业 | 500 | 2,580.00 | 0.01 |
| 593 | 000802 | 北京文化 | 200 | 2,214.00 | 0.01 |
| 594 | 002115 | 三维通信 | 200 | 1,974.00 | 0.00 |
| 595 | 603707 | 健友股份 | 100 | 1,877.00 | 0.00 |
| 596 | 002542 | 中化岩土 | 400 | 1,720.00 | 0.00 |
| 597 | 000996 | 中国中期 | 200 | 1,672.00 | 0.00 |
| 598 | 601139 | 深圳燃气 | 300 | 1,611.00 | 0.00 |
| 599 | 300085 | 银之杰 | 200 | 1,592.00 | 0.00 |
| 600 | 002564 | 天沃科技 | 300 | 1,506.00 | 0.00 |
| 601 | 002781 | 奇信股份 | 100 | 1,441.00 | 0.00 |
| 602 | 000976 | 华铁股份 | 300 | 1,374.00 | 0.00 |
| 603 | 600133 | 东湖高新 | 200 | 1,260.00 | 0.00 |
| 604 | 300252 | 金信诺 | 100 | 1,090.00 | 0.00 |
| 605 | 603399 | 吉翔股份 | 100 | 982.00 | 0.00 |
| 606 | 000582 | 北部湾港 | 100 | 704.00 | 0.00 |
| 607 | 002307 | 北新路桥 | 100 | 534.00 | 0.00 |

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

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
| 1 | 000719 | 中原传媒 | 5,500 | 43,285.00 | 0.10 |
| 2 | 600820 | 隧道股份 | 6,800 | 42,568.00 | 0.10 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 3,000 | 42,180.00 | 0.10 |
| 4 | 600510 | 黑牡丹 | 6,900 | 41,814.00 | 0.10 |
| 5 | 300403 | 汉宇集团 | 8,300 | 41,666.00 | 0.10 |
| 6 | 300196 | 长海股份 | 4,700 | 41,501.00 | 0.09 |
| 7 | 002339 | 积成电子 | 6,700 | 41,004.00 | 0.09 |
| 8 | 600606 | 绿地控股 | 6,700 | 40,937.00 | 0.09 |
| 9 | 601717 | 郑煤机 | 7,400 | 40,922.00 | 0.09 |
| 10 | 002150 | 通润装备 | 6,600 | 40,920.00 | 0.09 |
| 11 | 600292 | 远达环保 | 8,300 | 40,919.00 | 0.09 |
| 12 | 600894 | 广日股份 | 7,500 | 40,875.00 | 0.09 |
| 13 | 603020 | 爱普股份 | 5,500 | 40,865.00 | 0.09 |
| 14 | 600060 | 海信电器 | 4,700 | 40,796.00 | 0.09 |
| 15 | 600089 | 特变电工 | 6,000 | 40,740.00 | 0.09 |
| 16 | 002546 | 新联电子 | 10,800 | 40,716.00 | 0.09 |
| 17 | 002541 | 鸿路钢构 | 5,800 | 40,716.00 | 0.09 |
| 18 | 600611 | 大众交通 | 10,200 | 40,698.00 | 0.09 |
| 19 | 002048 | 宁波华翔 | 3,900 | 40,677.00 | 0.09 |
| 20 | 603611 | 诺力股份 | 3,300 | 40,524.00 | 0.09 |
| 21 | 601678 | 滨化股份 | 9,600 | 40,512.00 | 0.09 |
| 22 | 600713 | 南京医药 | 9,502 | 40,478.52 | 0.09 |
| 23 | 000900 | 现代投资 | 10,400 | 40,456.00 | 0.09 |
| 24 | 002589 | 瑞康医药 | 5,800 | 40,426.00 | 0.09 |
| 25 | 600051 | 宁波联合 | 7,500 | 40,425.00 | 0.09 |
| 26 | 000623 | 吉林敖东 | 2,800 | 40,404.00 | 0.09 |
| 27 | 600623 | 华谊集团 | 5,000 | 40,400.00 | 0.09 |
| 28 | 000926 | 福星股份 | 6,600 | 40,392.00 | 0.09 |
| 29 | 002140 | 东华科技 | 7,000 | 40,320.00 | 0.09 |
| 30 | 000157 | 中联重科 | 11,300 | 40,228.00 | 0.09 |
| 31 | 002160 | 常铝股份 | 10,900 | 40,221.00 | 0.09 |
| 32 | 000888 | 峨眉山Ａ | 7,100 | 40,186.00 | 0.09 |
| 33 | 600153 | 建发股份 | 5,700 | 40,185.00 | 0.09 |
| 34 | 600765 | 中航重机 | 5,400 | 40,176.00 | 0.09 |
| 35 | 603729 | 龙韵股份 | 2,600 | 40,144.00 | 0.09 |
| 36 | 600222 | 太龙药业 | 11,800 | 40,120.00 | 0.09 |
| 37 | 600482 | 中国动力 | 1,800 | 40,086.00 | 0.09 |
| 38 | 002317 | 众生药业 | 4,800 | 40,080.00 | 0.09 |
| 39 | 600356 | 恒丰纸业 | 7,300 | 40,077.00 | 0.09 |
| 40 | 300217 | 东方电热 | 17,200 | 40,076.00 | 0.09 |
| 41 | 600880 | 博瑞传播 | 10,800 | 40,068.00 | 0.09 |
| 42 | 300291 | 华录百纳 | 9,000 | 40,050.00 | 0.09 |
| 43 | 600565 | 迪马股份 | 15,400 | 40,040.00 | 0.09 |
| 44 | 600582 | 天地科技 | 11,700 | 40,014.00 | 0.09 |
| 45 | 002380 | 科远股份 | 3,800 | 40,014.00 | 0.09 |
| 46 | 600787 | 中储股份 | 8,000 | 40,000.00 | 0.09 |
| 47 | 002637 | 赞宇科技 | 5,600 | 39,984.00 | 0.09 |
| 48 | 300235 | 方直科技 | 4,900 | 39,935.00 | 0.09 |
| 49 | 600665 | 天地源 | 11,600 | 39,904.00 | 0.09 |
| 50 | 603306 | 华懋科技 | 2,800 | 39,900.00 | 0.09 |
| 51 | 000716 | 黑芝麻 | 14,300 | 39,897.00 | 0.09 |
| 52 | 002325 | 洪涛股份 | 13,700 | 39,867.00 | 0.09 |
| 53 | 002082 | 万邦德 | 5,400 | 39,852.00 | 0.09 |
| 54 | 600710 | 苏美达 | 10,800 | 39,852.00 | 0.09 |
| 55 | 300089 | 文化长城 | 7,500 | 39,825.00 | 0.09 |
| 56 | 603888 | 新华网 | 3,100 | 39,804.00 | 0.09 |
| 57 | 300437 | 清水源 | 3,400 | 39,712.00 | 0.09 |
| 58 | 600257 | 大湖股份 | 9,500 | 39,710.00 | 0.09 |
| 59 | 002081 | 金 螳 螂 | 4,900 | 39,690.00 | 0.09 |
| 60 | 002406 | 远东传动 | 7,500 | 39,675.00 | 0.09 |
| 61 | 000021 | 深科技 | 6,900 | 39,675.00 | 0.09 |
| 62 | 300566 | 激智科技 | 3,000 | 39,600.00 | 0.09 |
| 63 | 000589 | 黔轮胎Ａ | 11,800 | 39,530.00 | 0.09 |
| 64 | 600879 | 航天电子 | 7,300 | 39,493.00 | 0.09 |
| 65 | 002193 | 如意集团 | 4,500 | 39,420.00 | 0.09 |
| 66 | 601567 | 三星医疗 | 7,000 | 39,410.00 | 0.09 |
| 67 | 600830 | 香溢融通 | 8,200 | 39,278.00 | 0.09 |
| 68 | 002004 | 华邦健康 | 8,500 | 39,185.00 | 0.09 |
| 69 | 603968 | 醋化股份 | 3,100 | 39,184.00 | 0.09 |
| 70 | 600353 | 旭光股份 | 9,800 | 39,102.00 | 0.09 |
| 71 | 002391 | 长青股份 | 3,700 | 39,035.00 | 0.09 |
| 72 | 300136 | 信维通信 | 1,800 | 38,898.00 | 0.09 |
| 73 | 000581 | 威孚高科 | 2,200 | 38,852.00 | 0.09 |
| 74 | 600694 | 大商股份 | 1,600 | 38,704.00 | 0.09 |
| 75 | 300121 | 阳谷华泰 | 4,500 | 38,430.00 | 0.09 |
| 76 | 600854 | 春兰股份 | 10,300 | 35,844.00 | 0.08 |
| 77 | 601319 | 中国人保 | 6,288 | 33,829.44 | 0.08 |
| 78 | 300040 | 九洲电气 | 6,500 | 31,980.00 | 0.07 |
| 79 | 000619 | 海螺型材 | 6,000 | 31,140.00 | 0.07 |
| 80 | 600143 | 金发科技 | 5,800 | 28,710.00 | 0.07 |
| 81 | 600737 | 中粮糖业 | 3,900 | 28,704.00 | 0.07 |
| 82 | 600551 | 时代出版 | 3,300 | 28,446.00 | 0.06 |
| 83 | 600875 | 东方电气 | 3,600 | 28,404.00 | 0.06 |
| 84 | 600739 | 辽宁成大 | 2,700 | 28,242.00 | 0.06 |
| 85 | 600483 | 福能股份 | 3,300 | 28,050.00 | 0.06 |
| 86 | 300190 | 维尔利 | 5,700 | 28,044.00 | 0.06 |
| 87 | 300489 | 中飞股份 | 2,400 | 28,032.00 | 0.06 |
| 88 | 603886 | 元祖股份 | 1,600 | 28,000.00 | 0.06 |
| 89 | 002468 | 申通快递 | 1,700 | 27,965.00 | 0.06 |
| 90 | 000551 | 创元科技 | 4,800 | 27,888.00 | 0.06 |
| 91 | 603528 | 多伦科技 | 4,500 | 27,720.00 | 0.06 |
| 92 | 000978 | 桂林旅游 | 5,300 | 27,719.00 | 0.06 |
| 93 | 601339 | 百隆东方 | 5,000 | 27,650.00 | 0.06 |
| 94 | 600371 | 万向德农 | 4,400 | 27,500.00 | 0.06 |
| 95 | 002152 | 广电运通 | 4,900 | 27,489.00 | 0.06 |
| 96 | 000541 | 佛山照明 | 5,300 | 27,454.00 | 0.06 |
| 97 | 600790 | 轻纺城 | 7,500 | 27,375.00 | 0.06 |
| 98 | 600513 | 联环药业 | 4,600 | 27,370.00 | 0.06 |
| 99 | 603701 | 德宏股份 | 2,400 | 27,360.00 | 0.06 |
| 100 | 300330 | 华虹计通 | 3,900 | 27,261.00 | 0.06 |
| 101 | 603088 | 宁波精达 | 2,400 | 27,216.00 | 0.06 |
| 102 | 002688 | 金河生物 | 6,100 | 27,206.00 | 0.06 |
| 103 | 600561 | 江西长运 | 5,000 | 27,200.00 | 0.06 |
| 104 | 600537 | 亿晶光电 | 9,600 | 27,168.00 | 0.06 |
| 105 | 600881 | 亚泰集团 | 8,200 | 27,142.00 | 0.06 |
| 106 | 002083 | 孚日股份 | 5,500 | 27,115.00 | 0.06 |
| 107 | 000598 | 兴蓉环境 | 6,700 | 27,001.00 | 0.06 |
| 108 | 002454 | 松芝股份 | 6,600 | 26,994.00 | 0.06 |
| 109 | 300674 | 宇信科技 | 1,027 | 26,958.75 | 0.06 |
| 110 | 002561 | 徐家汇 | 3,500 | 26,950.00 | 0.06 |
| 111 | 600633 | 浙数文化 | 3,300 | 26,895.00 | 0.06 |
| 112 | 300026 | 红日药业 | 8,800 | 26,840.00 | 0.06 |
| 113 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,900 | 26,809.00 | 0.06 |
| 114 | 000425 | 徐工机械 | 8,300 | 26,809.00 | 0.06 |
| 115 | 600979 | 广安爱众 | 6,700 | 26,800.00 | 0.06 |
| 116 | 603669 | 灵康药业 | 2,700 | 26,730.00 | 0.06 |
| 117 | 601801 | 皖新传媒 | 4,000 | 26,720.00 | 0.06 |
| 118 | 600031 | 三一重工 | 3,200 | 26,688.00 | 0.06 |
| 119 | 002478 | 常宝股份 | 5,800 | 26,680.00 | 0.06 |
| 120 | 002037 | 久联发展 | 3,300 | 26,664.00 | 0.06 |
| 121 | 000862 | 银星能源 | 9,000 | 26,640.00 | 0.06 |
| 122 | 603887 | 城地股份 | 1,900 | 26,638.00 | 0.06 |
| 123 | 600177 | 雅戈尔 | 3,700 | 26,603.00 | 0.06 |
| 124 | 600586 | 金晶科技 | 9,400 | 26,602.00 | 0.06 |
| 125 | 600039 | 四川路桥 | 8,100 | 26,568.00 | 0.06 |
| 126 | 300421 | 力星股份 | 2,100 | 26,565.00 | 0.06 |
| 127 | 002615 | 哈尔斯 | 5,500 | 26,565.00 | 0.06 |
| 128 | 600017 | 日照港 | 9,600 | 26,496.00 | 0.06 |
| 129 | 601311 | 骆驼股份 | 3,000 | 26,490.00 | 0.06 |
| 130 | 300434 | 金石东方 | 3,000 | 26,400.00 | 0.06 |
| 131 | 600050 | 中国联通 | 5,100 | 26,367.00 | 0.06 |
| 132 | 002783 | 凯龙股份 | 4,100 | 26,363.00 | 0.06 |
| 133 | 600585 | 海螺水泥 | 900 | 26,352.00 | 0.06 |
| 134 | 600983 | 惠而浦 | 5,000 | 26,300.00 | 0.06 |
| 135 | 600969 | 郴电国际 | 4,400 | 26,092.00 | 0.06 |
| 136 | 002013 | 中航机电 | 4,000 | 26,040.00 | 0.06 |
| 137 | 600609 | 金杯汽车 | 8,400 | 26,040.00 | 0.06 |
| 138 | 603090 | 宏盛股份 | 2,000 | 25,960.00 | 0.06 |
| 139 | 300154 | 瑞凌股份 | 5,400 | 25,920.00 | 0.06 |
| 140 | 002661 | 克明面业 | 2,100 | 25,914.00 | 0.06 |
| 141 | 603355 | 莱克电气 | 1,200 | 25,800.00 | 0.06 |
| 142 | 600573 | 惠泉啤酒 | 4,100 | 25,789.00 | 0.06 |
| 143 | 600697 | 欧亚集团 | 1,400 | 25,746.00 | 0.06 |
| 144 | 002404 | 嘉欣丝绸 | 4,800 | 25,680.00 | 0.06 |
| 145 | 300275 | 梅安森 | 3,400 | 25,636.00 | 0.06 |
| 146 | 002373 | 千方科技 | 2,300 | 25,576.00 | 0.06 |
| 147 | 300556 | 丝路视觉 | 1,600 | 25,552.00 | 0.06 |
| 148 | 002088 | 鲁阳节能 | 3,000 | 25,410.00 | 0.06 |
| 149 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,100 | 25,410.00 | 0.06 |
| 150 | 002771 | 真视通 | 2,300 | 25,392.00 | 0.06 |
| 151 | 000531 | 穗恒运Ａ | 5,000 | 25,300.00 | 0.06 |
| 152 | 601231 | 环旭电子 | 2,800 | 25,200.00 | 0.06 |
| 153 | 000938 | 紫光股份 | 800 | 25,008.00 | 0.06 |
| 154 | 603168 | 莎普爱思 | 3,600 | 24,660.00 | 0.06 |
| 155 | 600037 | 歌华有线 | 2,800 | 24,052.00 | 0.05 |
| 156 | 002416 | 爱施德 | 3,800 | 22,344.00 | 0.05 |
| 157 | 603288 | 海天味业 | 300 | 20,640.00 | 0.05 |
| 158 | 600636 | 三爱富 | 1,800 | 19,422.00 | 0.04 |
| 159 | 000430 | 张家界 | 4,000 | 19,360.00 | 0.04 |
| 160 | 002729 | 好利来 | 900 | 18,540.00 | 0.04 |
| 161 | 603030 | 全筑股份 | 3,600 | 18,360.00 | 0.04 |
| 162 | 000028 | 国药一致 | 400 | 16,576.00 | 0.04 |
| 163 | 300375 | 鹏翎股份 | 2,900 | 15,689.00 | 0.04 |
| 164 | 300546 | 雄帝科技 | 600 | 15,540.00 | 0.04 |
| 165 | 603663 | 三祥新材 | 900 | 15,300.00 | 0.03 |
| 166 | 000702 | 正虹科技 | 2,700 | 15,012.00 | 0.03 |
| 167 | 300394 | 天孚通信 | 600 | 14,502.00 | 0.03 |
| 168 | 000848 | 承德露露 | 1,800 | 14,472.00 | 0.03 |
| 169 | 000695 | 滨海能源 | 1,600 | 14,400.00 | 0.03 |
| 170 | 600557 | 康缘药业 | 1,400 | 14,392.00 | 0.03 |
| 171 | 600587 | 新华医疗 | 1,100 | 14,366.00 | 0.03 |
| 172 | 300427 | 红相股份 | 1,300 | 14,352.00 | 0.03 |
| 173 | 000948 | 南天信息 | 1,500 | 14,310.00 | 0.03 |
| 174 | 601928 | 凤凰传媒 | 1,800 | 14,292.00 | 0.03 |
| 175 | 600113 | 浙江东日 | 2,000 | 14,260.00 | 0.03 |
| 176 | 300525 | 博思软件 | 600 | 14,244.00 | 0.03 |
| 177 | 000537 | 广宇发展 | 1,900 | 14,231.00 | 0.03 |
| 178 | 603918 | 金桥信息 | 1,200 | 14,220.00 | 0.03 |
| 179 | 002706 | 良信电器 | 2,300 | 14,191.00 | 0.03 |
| 180 | 300569 | 天能重工 | 1,100 | 14,135.00 | 0.03 |
| 181 | 300093 | 金刚玻璃 | 2,300 | 14,053.00 | 0.03 |
| 182 | 000617 | 中油资本 | 1,300 | 13,975.00 | 0.03 |
| 183 | 601168 | 西部矿业 | 2,400 | 13,968.00 | 0.03 |
| 184 | 300442 | 普丽盛 | 1,100 | 13,937.00 | 0.03 |
| 185 | 300383 | 光环新网 | 1,100 | 13,937.00 | 0.03 |
| 186 | 002244 | 滨江集团 | 3,500 | 13,930.00 | 0.03 |
| 187 | 000159 | 国际实业 | 3,300 | 13,926.00 | 0.03 |
| 188 | 600390 | 五矿资本 | 2,000 | 13,920.00 | 0.03 |
| 189 | 600861 | 北京城乡 | 2,000 | 13,900.00 | 0.03 |
| 190 | 600865 | 百大集团 | 2,500 | 13,875.00 | 0.03 |
| 191 | 600594 | 益佰制药 | 2,500 | 13,800.00 | 0.03 |
| 192 | 002559 | 亚威股份 | 2,100 | 13,797.00 | 0.03 |
| 193 | 600657 | 信达地产 | 3,500 | 13,755.00 | 0.03 |
| 194 | 002435 | 长江润发 | 2,600 | 13,754.00 | 0.03 |
| 195 | 002438 | 江苏神通 | 2,400 | 13,752.00 | 0.03 |
| 196 | 600081 | 东风科技 | 1,900 | 13,737.00 | 0.03 |
| 197 | 000050 | 深天马Ａ | 1,400 | 13,734.00 | 0.03 |
| 198 | 600543 | 莫高股份 | 2,100 | 13,713.00 | 0.03 |
| 199 | 002274 | 华昌化工 | 2,700 | 13,689.00 | 0.03 |
| 200 | 000863 | 三湘印象 | 3,500 | 13,685.00 | 0.03 |
| 201 | 600481 | 双良节能 | 4,100 | 13,653.00 | 0.03 |
| 202 | 601966 | 玲珑轮胎 | 1,000 | 13,650.00 | 0.03 |
| 203 | 300254 | 仟源医药 | 2,100 | 13,608.00 | 0.03 |
| 204 | 002442 | 龙星化工 | 1,800 | 13,608.00 | 0.03 |
| 205 | 601607 | 上海医药 | 800 | 13,600.00 | 0.03 |
| 206 | 600617 | 国新能源 | 2,800 | 13,580.00 | 0.03 |
| 207 | 600780 | 通宝能源 | 4,200 | 13,566.00 | 0.03 |
| 208 | 600823 | 世茂股份 | 3,600 | 13,536.00 | 0.03 |
| 209 | 300405 | 科隆股份 | 1,800 | 13,536.00 | 0.03 |
| 210 | 002498 | 汉缆股份 | 6,800 | 13,532.00 | 0.03 |
| 211 | 600395 | 盘江股份 | 2,700 | 13,527.00 | 0.03 |
| 212 | 600366 | 宁波韵升 | 2,700 | 13,527.00 | 0.03 |
| 213 | 000402 | 金 融 街 | 2,100 | 13,524.00 | 0.03 |
| 214 | 000798 | 中水渔业 | 2,600 | 13,520.00 | 0.03 |
| 215 | 002392 | 北京利尔 | 4,200 | 13,440.00 | 0.03 |
| 216 | 002696 | 百洋股份 | 1,500 | 13,440.00 | 0.03 |
| 217 | 000417 | 合肥百货 | 3,100 | 13,423.00 | 0.03 |
| 218 | 000922 | 佳电股份 | 2,000 | 13,420.00 | 0.03 |
| 219 | 002627 | 宜昌交运 | 2,100 | 13,419.00 | 0.03 |
| 220 | 000078 | 海王生物 | 4,500 | 13,410.00 | 0.03 |
| 221 | 600829 | 人民同泰 | 2,300 | 13,409.00 | 0.03 |
| 222 | 300270 | 中威电子 | 2,100 | 13,398.00 | 0.03 |
| 223 | 603025 | 大豪科技 | 1,200 | 13,380.00 | 0.03 |
| 224 | 600888 | 新疆众和 | 3,200 | 13,376.00 | 0.03 |
| 225 | 300159 | 新研股份 | 2,900 | 13,369.00 | 0.03 |
| 226 | 000715 | 中兴商业 | 2,300 | 13,363.00 | 0.03 |
| 227 | 601018 | 宁波港 | 4,000 | 13,360.00 | 0.03 |
| 228 | 300470 | 日机密封 | 600 | 13,350.00 | 0.03 |
| 229 | 000767 | 漳泽电力 | 5,400 | 13,338.00 | 0.03 |
| 230 | 002682 | 龙洲股份 | 3,100 | 13,330.00 | 0.03 |
| 231 | 000756 | 新华制药 | 2,400 | 13,320.00 | 0.03 |
| 232 | 600006 | 东风汽车 | 3,700 | 13,320.00 | 0.03 |
| 233 | 300250 | 初灵信息 | 1,200 | 13,320.00 | 0.03 |
| 234 | 300017 | 网宿科技 | 1,700 | 13,311.00 | 0.03 |
| 235 | 603929 | 亚翔集成 | 900 | 13,302.00 | 0.03 |
| 236 | 600101 | 明星电力 | 2,000 | 13,300.00 | 0.03 |
| 237 | 600219 | 南山铝业 | 6,300 | 13,293.00 | 0.03 |
| 238 | 300227 | 光韵达 | 1,400 | 13,286.00 | 0.03 |
| 239 | 600558 | 大西洋 | 4,200 | 13,272.00 | 0.03 |
| 240 | 600160 | 巨化股份 | 2,000 | 13,260.00 | 0.03 |
| 241 | 600782 | 新钢股份 | 2,600 | 13,234.00 | 0.03 |
| 242 | 600509 | 天富能源 | 3,700 | 13,209.00 | 0.03 |
| 243 | 002566 | 益盛药业 | 2,300 | 13,202.00 | 0.03 |
| 244 | 600479 | 千金药业 | 1,700 | 13,192.00 | 0.03 |
| 245 | 300246 | 宝莱特 | 1,200 | 13,188.00 | 0.03 |
| 246 | 000012 | 南 玻Ａ | 3,300 | 13,167.00 | 0.03 |
| 247 | 002312 | 三泰控股 | 4,200 | 13,146.00 | 0.03 |
| 248 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,800 | 13,132.00 | 0.03 |
| 249 | 002728 | 特一药业 | 1,000 | 13,120.00 | 0.03 |
| 250 | 002360 | 同德化工 | 2,400 | 13,104.00 | 0.03 |
| 251 | 000698 | 沈阳化工 | 3,600 | 13,104.00 | 0.03 |
| 252 | 002361 | 神剑股份 | 3,600 | 13,104.00 | 0.03 |
| 253 | 601216 | 君正集团 | 5,000 | 13,100.00 | 0.03 |
| 254 | 000570 | 苏常柴Ａ | 3,500 | 13,090.00 | 0.03 |
| 255 | 002738 | 中矿资源 | 900 | 13,086.00 | 0.03 |
| 256 | 600731 | 湖南海利 | 3,100 | 13,082.00 | 0.03 |
| 257 | 300010 | 立思辰 | 1,800 | 13,068.00 | 0.03 |
| 258 | 000419 | 通程控股 | 3,200 | 13,056.00 | 0.03 |
| 259 | 002062 | 宏润建设 | 3,400 | 13,056.00 | 0.03 |
| 260 | 603369 | 今世缘 | 900 | 13,041.00 | 0.03 |
| 261 | 002487 | 大金重工 | 3,900 | 13,026.00 | 0.03 |
| 262 | 300058 | 蓝色光标 | 3,000 | 13,020.00 | 0.03 |
| 263 | 300552 | 万集科技 | 900 | 12,960.00 | 0.03 |
| 264 | 300239 | 东宝生物 | 3,500 | 12,950.00 | 0.03 |
| 265 | 600971 | 恒源煤电 | 2,300 | 12,949.00 | 0.03 |
| 266 | 601872 | 招商轮船 | 3,500 | 12,915.00 | 0.03 |
| 267 | 300324 | 旋极信息 | 2,300 | 12,903.00 | 0.03 |
| 268 | 600367 | 红星发展 | 1,800 | 12,888.00 | 0.03 |
| 269 | 603328 | 依顿电子 | 1,300 | 12,870.00 | 0.03 |
| 270 | 300182 | 捷成股份 | 3,000 | 12,870.00 | 0.03 |
| 271 | 002532 | 新界泵业 | 2,600 | 12,844.00 | 0.03 |
| 272 | 601233 | 桐昆股份 | 1,300 | 12,688.00 | 0.03 |
| 273 | 002111 | 威海广泰 | 1,300 | 12,662.00 | 0.03 |
| 274 | 300321 | 同大股份 | 1,000 | 12,650.00 | 0.03 |
| 275 | 600843 | 上工申贝 | 1,900 | 12,616.00 | 0.03 |
| 276 | 300460 | 惠伦晶体 | 1,500 | 12,555.00 | 0.03 |
| 277 | 002713 | 东易日盛 | 800 | 12,544.00 | 0.03 |
| 278 | 600361 | 华联综超 | 3,700 | 12,543.00 | 0.03 |
| 279 | 300389 | 艾比森 | 800 | 12,504.00 | 0.03 |
| 280 | 300088 | 长信科技 | 3,000 | 12,450.00 | 0.03 |
| 281 | 600419 | 天润乳业 | 900 | 12,384.00 | 0.03 |
| 282 | 000042 | 中洲控股 | 1,100 | 12,342.00 | 0.03 |
| 283 | 300423 | 鲁亿通 | 700 | 12,341.00 | 0.03 |
| 284 | 002601 | 龙蟒佰利 | 1,000 | 12,300.00 | 0.03 |
| 285 | 300530 | 达志科技 | 400 | 12,264.00 | 0.03 |
| 286 | 603869 | 新智认知 | 800 | 12,032.00 | 0.03 |
| 287 | 300146 | 汤臣倍健 | 700 | 11,893.00 | 0.03 |
| 288 | 600260 | 凯乐科技 | 700 | 11,879.00 | 0.03 |
| 289 | 600839 | 四川长虹 | 5,100 | 11,781.00 | 0.03 |
| 290 | 002815 | 崇达技术 | 800 | 11,688.00 | 0.03 |
| 291 | 603518 | 维格娜丝 | 800 | 11,280.00 | 0.03 |
| 292 | 603737 | 三棵树 | 300 | 10,908.00 | 0.02 |
| 293 | 600777 | 新潮能源 | 5,500 | 10,505.00 | 0.02 |
| 294 | 600386 | 北巴传媒 | 3,100 | 10,292.00 | 0.02 |
| 295 | 603228 | 景旺电子 | 200 | 9,998.00 | 0.02 |
| 296 | 603556 | 海兴电力 | 700 | 9,100.00 | 0.02 |
| 297 | 002613 | 北玻股份 | 2,900 | 7,714.00 | 0.02 |
| 298 | 000039 | 中集集团 | 700 | 7,406.00 | 0.02 |
| 299 | 000708 | 大冶特钢 | 800 | 7,016.00 | 0.02 |
| 300 | 000501 | 鄂武商Ａ | 700 | 6,636.00 | 0.02 |
| 301 | 300329 | 海伦钢琴 | 900 | 6,363.00 | 0.01 |
| 302 | 002051 | 中工国际 | 500 | 5,540.00 | 0.01 |
| 303 | 600980 | 北矿科技 | 400 | 3,916.00 | 0.01 |
| 304 | 600028 | 中国石化 | 700 | 3,535.00 | 0.01 |

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动**

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

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
| 1 | 601799 | 星宇股份 | 9,970,643.00 | 4.63 |
| 2 | 600622 | 光大嘉宝 | 9,259,099.58 | 4.30 |
| 3 | 600567 | 山鹰纸业 | 8,794,579.90 | 4.08 |
| 4 | 300271 | 华宇软件 | 8,556,007.71 | 3.97 |
| 5 | 000818 | 航锦科技 | 8,184,314.71 | 3.80 |
| 6 | 002449 | 国星光电 | 7,751,396.00 | 3.60 |
| 7 | 002429 | 兆驰股份 | 7,349,609.50 | 3.41 |
| 8 | 002025 | 航天电器 | 7,339,492.69 | 3.41 |
| 9 | 002383 | 合众思壮 | 7,311,698.34 | 3.40 |
| 10 | 002080 | 中材科技 | 7,293,559.60 | 3.39 |
| 11 | 600486 | 扬农化工 | 7,139,526.35 | 3.32 |
| 12 | 601126 | 四方股份 | 7,128,962.54 | 3.31 |
| 13 | 000040 | 东旭蓝天 | 7,096,607.89 | 3.30 |
| 14 | 600261 | 阳光照明 | 6,768,629.00 | 3.14 |
| 15 | 000591 | 太阳能 | 6,765,937.80 | 3.14 |
| 16 | 601222 | 林洋能源 | 6,748,248.00 | 3.13 |
| 17 | 600252 | 中恒集团 | 6,444,342.00 | 2.99 |
| 18 | 600269 | 赣粤高速 | 6,432,871.00 | 2.99 |
| 19 | 600470 | 六国化工 | 6,408,473.29 | 2.98 |
| 20 | 000650 | 仁和药业 | 6,362,520.00 | 2.96 |
| 21 | 600803 | 新奥股份 | 6,295,865.62 | 2.92 |
| 22 | 603898 | 好莱客 | 6,267,253.00 | 2.91 |
| 23 | 300098 | 高新兴 | 6,255,603.03 | 2.91 |
| 24 | 600667 | 太极实业 | 6,219,189.00 | 2.89 |
| 25 | 600963 | 岳阳林纸 | 6,157,589.81 | 2.86 |
| 26 | 002247 | 聚力文化 | 6,062,611.00 | 2.82 |
| 27 | 600491 | 龙元建设 | 6,057,552.00 | 2.81 |
| 28 | 600057 | 厦门象屿 | 6,035,588.40 | 2.80 |
| 29 | 002067 | 景兴纸业 | 6,033,760.00 | 2.80 |
| 30 | 600114 | 东睦股份 | 5,918,004.62 | 2.75 |
| 31 | 300157 | 恒泰艾普 | 5,901,794.56 | 2.74 |
| 32 | 000042 | 中洲控股 | 5,815,926.88 | 2.70 |
| 33 | 000683 | 远兴能源 | 5,775,752.00 | 2.68 |
| 34 | 600629 | 华建集团 | 5,717,399.12 | 2.66 |
| 35 | 600775 | 南京熊猫 | 5,716,124.36 | 2.65 |
| 36 | 600331 | 宏达股份 | 5,694,457.00 | 2.64 |
| 37 | 600172 | 黄河旋风 | 5,638,401.80 | 2.62 |
| 38 | 603368 | 柳药股份 | 5,625,819.20 | 2.61 |
| 39 | 300050 | 世纪鼎利 | 5,620,597.00 | 2.61 |
| 40 | 300485 | 赛升药业 | 5,620,040.00 | 2.61 |
| 41 | 603979 | 金诚信 | 5,619,688.92 | 2.61 |
| 42 | 300297 | 蓝盾股份 | 5,600,998.02 | 2.60 |
| 43 | 600508 | 上海能源 | 5,586,640.53 | 2.59 |
| 44 | 000065 | 北方国际 | 5,544,529.01 | 2.58 |
| 45 | 600686 | 金龙汽车 | 5,541,962.00 | 2.57 |
| 46 | 600323 | 瀚蓝环境 | 5,537,584.52 | 2.57 |
| 47 | 000553 | 沙隆达Ａ | 5,453,250.00 | 2.53 |
| 48 | 600063 | 皖维高新 | 5,405,362.44 | 2.51 |
| 49 | 002543 | 万和电气 | 5,398,454.90 | 2.51 |
| 50 | 000525 | 红 太 阳 | 5,375,358.00 | 2.50 |
| 51 | 002483 | 润邦股份 | 5,369,242.40 | 2.49 |
| 52 | 600123 | 兰花科创 | 5,308,804.00 | 2.47 |
| 53 | 000860 | 顺鑫农业 | 5,266,625.00 | 2.45 |
| 54 | 600035 | 楚天高速 | 5,265,126.00 | 2.45 |
| 55 | 300177 | 中海达 | 5,232,047.58 | 2.43 |
| 56 | 300349 | 金卡智能 | 5,178,702.84 | 2.41 |
| 57 | 300447 | 全信股份 | 5,174,689.10 | 2.40 |
| 58 | 000925 | 众合科技 | 5,169,921.19 | 2.40 |
| 59 | 002484 | 江海股份 | 5,169,081.80 | 2.40 |
| 60 | 600143 | 金发科技 | 5,133,767.00 | 2.38 |
| 61 | 000601 | 韶能股份 | 5,109,043.75 | 2.37 |
| 62 | 002185 | 华天科技 | 5,100,268.00 | 2.37 |
| 63 | 600548 | 深高速 | 5,092,443.00 | 2.37 |
| 64 | 002372 | 伟星新材 | 5,062,689.00 | 2.35 |
| 65 | 600551 | 时代出版 | 5,039,311.81 | 2.34 |
| 66 | 300347 | 泰格医药 | 5,025,225.22 | 2.33 |
| 67 | 600742 | 一汽富维 | 5,003,712.36 | 2.32 |
| 68 | 002393 | 力生制药 | 4,978,708.00 | 2.31 |
| 69 | 300307 | 慈星股份 | 4,930,916.00 | 2.29 |
| 70 | 601666 | 平煤股份 | 4,920,080.68 | 2.29 |
| 71 | 300114 | 中航电测 | 4,882,024.75 | 2.27 |
| 72 | 002341 | 新纶科技 | 4,864,281.11 | 2.26 |
| 73 | 000733 | 振华科技 | 4,831,296.00 | 2.24 |
| 74 | 002680 | \*ST长生 | 4,785,066.00 | 2.22 |
| 75 | 000030 | 富奥股份 | 4,785,039.14 | 2.22 |
| 76 | 002597 | 金禾实业 | 4,756,450.68 | 2.21 |
| 77 | 600777 | 新潮能源 | 4,670,179.00 | 2.17 |
| 78 | 000159 | 国际实业 | 4,664,315.64 | 2.17 |
| 79 | 600285 | 羚锐制药 | 4,648,193.03 | 2.16 |
| 80 | 002507 | 涪陵榨菜 | 4,646,860.72 | 2.16 |
| 81 | 600577 | 精达股份 | 4,645,593.00 | 2.16 |
| 82 | 300054 | 鼎龙股份 | 4,501,699.20 | 2.09 |
| 83 | 000059 | 华锦股份 | 4,478,487.00 | 2.08 |
| 84 | 600382 | 广东明珠 | 4,475,647.64 | 2.08 |
| 85 | 002433 | 太安堂 | 4,470,312.00 | 2.08 |
| 86 | 600502 | 安徽水利 | 4,445,411.00 | 2.06 |
| 87 | 600101 | 明星电力 | 4,443,722.00 | 2.06 |
| 88 | 603328 | 依顿电子 | 4,442,997.94 | 2.06 |
| 89 | 600674 | 川投能源 | 4,421,540.92 | 2.05 |
| 90 | 300219 | 鸿利智汇 | 4,392,784.00 | 2.04 |
| 91 | 600681 | 百川能源 | 4,384,021.00 | 2.04 |
| 92 | 002097 | 山河智能 | 4,364,489.00 | 2.03 |
| 93 | 600255 | 梦舟股份 | 4,357,851.00 | 2.02 |
| 94 | 002091 | 江苏国泰 | 4,357,281.59 | 2.02 |
| 95 | 601107 | 四川成渝 | 4,348,897.00 | 2.02 |
| 96 | 300232 | 洲明科技 | 4,314,051.12 | 2.00 |

注：本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
| 1 | 601799 | 星宇股份 | 9,929,027.04 | 4.61 |
| 2 | 600486 | 扬农化工 | 9,563,181.65 | 4.44 |
| 3 | 600567 | 山鹰纸业 | 9,199,644.00 | 4.27 |
| 4 | 300271 | 华宇软件 | 9,098,545.37 | 4.23 |
| 5 | 600622 | 光大嘉宝 | 8,777,603.37 | 4.08 |
| 6 | 002449 | 国星光电 | 8,642,540.54 | 4.01 |
| 7 | 000818 | 航锦科技 | 8,175,092.00 | 3.80 |
| 8 | 000042 | 中洲控股 | 8,102,991.57 | 3.76 |
| 9 | 002372 | 伟星新材 | 7,979,893.82 | 3.71 |
| 10 | 600114 | 东睦股份 | 7,977,336.04 | 3.71 |
| 11 | 002247 | 聚力文化 | 7,895,236.32 | 3.67 |
| 12 | 600686 | 金龙汽车 | 7,687,494.55 | 3.57 |
| 13 | 000553 | 沙隆达Ａ | 7,520,634.00 | 3.49 |
| 14 | 600261 | 阳光照明 | 7,498,792.55 | 3.48 |
| 15 | 600491 | 龙元建设 | 7,276,130.00 | 3.38 |
| 16 | 002483 | 润邦股份 | 7,241,568.82 | 3.36 |
| 17 | 002025 | 航天电器 | 7,230,034.00 | 3.36 |
| 18 | 002429 | 兆驰股份 | 7,226,448.00 | 3.36 |
| 19 | 002383 | 合众思壮 | 7,116,648.00 | 3.31 |
| 20 | 600548 | 深高速 | 7,061,084.41 | 3.28 |
| 21 | 601126 | 四方股份 | 7,008,326.64 | 3.26 |
| 22 | 002080 | 中材科技 | 6,966,817.40 | 3.24 |
| 23 | 600323 | 瀚蓝环境 | 6,944,902.30 | 3.23 |
| 24 | 603368 | 柳药股份 | 6,863,029.00 | 3.19 |
| 25 | 000040 | 东旭蓝天 | 6,811,378.40 | 3.16 |
| 26 | 603898 | 好莱客 | 6,808,017.80 | 3.16 |
| 27 | 300485 | 赛升药业 | 6,758,992.20 | 3.14 |
| 28 | 300447 | 全信股份 | 6,703,764.20 | 3.11 |
| 29 | 000591 | 太阳能 | 6,627,065.00 | 3.08 |
| 30 | 000921 | 海信家电 | 6,597,192.65 | 3.06 |
| 31 | 603979 | 金诚信 | 6,584,800.54 | 3.06 |
| 32 | 600285 | 羚锐制药 | 6,561,622.06 | 3.05 |
| 33 | 600331 | 宏达股份 | 6,540,469.25 | 3.04 |
| 34 | 300219 | 鸿利智汇 | 6,521,260.00 | 3.03 |
| 35 | 600173 | 卧龙地产 | 6,458,648.70 | 3.00 |
| 36 | 600508 | 上海能源 | 6,407,504.46 | 2.98 |
| 37 | 600470 | 六国化工 | 6,402,231.36 | 2.97 |
| 38 | 000065 | 北方国际 | 6,387,600.50 | 2.97 |
| 39 | 000525 | 红 太 阳 | 6,383,267.40 | 2.96 |
| 40 | 300050 | 世纪鼎利 | 6,327,981.30 | 2.94 |
| 41 | 601107 | 四川成渝 | 6,311,684.32 | 2.93 |
| 42 | 601666 | 平煤股份 | 6,277,585.00 | 2.92 |
| 43 | 600269 | 赣粤高速 | 6,270,424.00 | 2.91 |
| 44 | 601222 | 林洋能源 | 6,237,584.00 | 2.90 |
| 45 | 300098 | 高新兴 | 6,212,198.05 | 2.89 |
| 46 | 600252 | 中恒集团 | 6,187,947.85 | 2.87 |
| 47 | 000650 | 仁和药业 | 6,109,547.25 | 2.84 |
| 48 | 600667 | 太极实业 | 6,107,298.00 | 2.84 |
| 49 | 600963 | 岳阳林纸 | 6,098,221.04 | 2.83 |
| 50 | 600337 | 美克家居 | 6,052,695.99 | 2.81 |
| 51 | 600803 | 新奥股份 | 6,027,672.14 | 2.80 |
| 52 | 600057 | 厦门象屿 | 5,987,260.92 | 2.78 |
| 53 | 002067 | 景兴纸业 | 5,944,595.06 | 2.76 |
| 54 | 300194 | 福安药业 | 5,795,281.00 | 2.69 |
| 55 | 002121 | 科陆电子 | 5,767,943.00 | 2.68 |
| 56 | 600775 | 南京熊猫 | 5,713,055.00 | 2.65 |
| 57 | 600736 | 苏州高新 | 5,616,781.35 | 2.61 |
| 58 | 300297 | 蓝盾股份 | 5,616,242.00 | 2.61 |
| 59 | 000683 | 远兴能源 | 5,614,318.20 | 2.61 |
| 60 | 600035 | 楚天高速 | 5,599,643.20 | 2.60 |
| 61 | 600629 | 华建集团 | 5,588,375.80 | 2.60 |
| 62 | 300323 | 华灿光电 | 5,565,901.00 | 2.59 |
| 63 | 600172 | 黄河旋风 | 5,516,042.60 | 2.56 |
| 64 | 600101 | 明星电力 | 5,508,127.60 | 2.56 |
| 65 | 600582 | 天地科技 | 5,492,852.00 | 2.55 |
| 66 | 000860 | 顺鑫农业 | 5,428,848.93 | 2.52 |
| 67 | 002543 | 万和电气 | 5,363,061.83 | 2.49 |
| 68 | 002139 | 拓邦股份 | 5,356,820.00 | 2.49 |
| 69 | 300232 | 洲明科技 | 5,339,261.70 | 2.48 |
| 70 | 002100 | 天康生物 | 5,321,803.40 | 2.47 |
| 71 | 600063 | 皖维高新 | 5,278,886.83 | 2.45 |
| 72 | 300177 | 中海达 | 5,270,661.00 | 2.45 |
| 73 | 600105 | 永鼎股份 | 5,263,433.12 | 2.44 |
| 74 | 603669 | 灵康药业 | 5,254,686.08 | 2.44 |
| 75 | 600742 | 一汽富维 | 5,233,011.20 | 2.43 |
| 76 | 300157 | 恒泰艾普 | 5,215,480.00 | 2.42 |
| 77 | 600123 | 兰花科创 | 5,146,465.00 | 2.39 |
| 78 | 002680 | \*ST长生 | 5,105,919.63 | 2.37 |
| 79 | 600824 | 益民集团 | 5,084,763.95 | 2.36 |
| 80 | 300114 | 中航电测 | 5,053,364.50 | 2.35 |
| 81 | 000925 | 众合科技 | 5,046,552.05 | 2.34 |
| 82 | 600990 | 四创电子 | 5,044,270.54 | 2.34 |
| 83 | 000902 | 新洋丰 | 5,038,303.12 | 2.34 |
| 84 | 600551 | 时代出版 | 5,031,004.20 | 2.34 |
| 85 | 300347 | 泰格医药 | 5,023,117.24 | 2.33 |
| 86 | 002484 | 江海股份 | 4,998,999.26 | 2.32 |
| 87 | 300349 | 金卡智能 | 4,996,276.80 | 2.32 |
| 88 | 002185 | 华天科技 | 4,966,411.92 | 2.31 |
| 89 | 002376 | 新北洋 | 4,960,095.00 | 2.30 |
| 90 | 600219 | 南山铝业 | 4,949,319.00 | 2.30 |
| 91 | 000719 | 中原传媒 | 4,932,372.28 | 2.29 |
| 92 | 600143 | 金发科技 | 4,903,483.00 | 2.28 |
| 93 | 002597 | 金禾实业 | 4,903,245.00 | 2.28 |
| 94 | 002518 | 科士达 | 4,848,349.90 | 2.25 |
| 95 | 000601 | 韶能股份 | 4,835,720.10 | 2.25 |
| 96 | 300438 | 鹏辉能源 | 4,810,384.20 | 2.23 |
| 97 | 601900 | 南方传媒 | 4,765,244.20 | 2.21 |
| 98 | 600502 | 安徽水利 | 4,744,699.60 | 2.20 |
| 99 | 300036 | 超图软件 | 4,727,650.36 | 2.20 |
| 100 | 002507 | 涪陵榨菜 | 4,717,263.85 | 2.19 |
| 101 | 300047 | 天源迪科 | 4,712,996.15 | 2.19 |
| 102 | 000070 | 特发信息 | 4,671,841.38 | 2.17 |
| 103 | 002393 | 力生制药 | 4,666,199.00 | 2.17 |
| 104 | 000059 | 华锦股份 | 4,641,045.00 | 2.16 |
| 105 | 000030 | 富奥股份 | 4,624,067.40 | 2.15 |
| 106 | 002341 | 新纶科技 | 4,624,041.05 | 2.15 |
| 107 | 002737 | 葵花药业 | 4,612,658.00 | 2.14 |
| 108 | 000733 | 振华科技 | 4,539,285.00 | 2.11 |
| 109 | 300307 | 慈星股份 | 4,527,247.00 | 2.10 |
| 110 | 600552 | 凯盛科技 | 4,526,976.58 | 2.10 |
| 111 | 601137 | 博威合金 | 4,482,954.62 | 2.08 |
| 112 | 000159 | 国际实业 | 4,480,232.00 | 2.08 |
| 113 | 600577 | 精达股份 | 4,406,228.00 | 2.05 |
| 114 | 300118 | 东方日升 | 4,399,503.50 | 2.04 |
| 115 | 600674 | 川投能源 | 4,382,167.00 | 2.04 |
| 116 | 002433 | 太安堂 | 4,380,144.00 | 2.03 |
| 117 | 300336 | 新文化 | 4,373,247.08 | 2.03 |
| 118 | 603328 | 依顿电子 | 4,362,430.06 | 2.03 |
| 119 | 600777 | 新潮能源 | 4,341,479.00 | 2.02 |
| 120 | 600382 | 广东明珠 | 4,321,604.00 | 2.01 |
| 121 | 600681 | 百川能源 | 4,315,342.00 | 2.00 |

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

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

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,199,636.00 | 5.02 |
|  | 其中：政策性金融债 | 2,199,636.00 | 5.02 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 28,944.80 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,228,580.80 | 5.08 |

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

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

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

|  |
| --- |
|  |

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

|  |
| --- |
|  |

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

|  |
| --- |
|  |

本基金本报告期未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 2018年8月29日，湖北能源集团股份有限公司（以下简称公司）收到中国证券监督管理委员会湖北监管局《关于对湖北能源集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》，被认为公司存在公司日常管理和财务系统未独立于控股股东和公司年报中关于独立性的披露不准确两条违反《上市公司信息披露管理办法》的情形。公司被要求责令改正，并按要求制定切实可行的整改计划，在规定时间内向湖北证监局提交书面整改报告，切实整改相关问题。 本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，湖北能源公司改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。该公司作为全国大型电力、热力生产和供应业企业之一，目前估值处于历史底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对湖北能源进行了投资。 山东新北洋信息技术股份有限公司（以下简称"新北洋"或"公司"）于近日收到中国证券监督管理委员会山东监管局（以下简称"山东证监局"）行政监管措施决定书，被认为公司存在内幕信息知情人登记不完整和未制作重大事项进程备忘录等问题，具体而言包括内幕信息知情人登记不完整、部分涉及内幕信息事项未登记和未建立重大事项进程备忘录三项问题，违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，被山东证监局出具警示函。 本基金投研人员分析认为，公司在收到上述决定书后，公司董事会和管理层对上述问题高度重视，并以整改为契机，加强了对各证券法律法规的学习，提高了信息披露质量。该事件发生后该公司经营状况正常。该公司作为中国电子信息行业创新能力五十强企业，拥有"国家认定企业技术中心""专用打印技术及集成国家地方联合工程实验室"，连续多年荣膺CCTV中国上市公司"创新十强"，目前估值处于历史底部，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对新北洋进行了投资。**

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

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

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

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

**§9  基金份额持有人信息**

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
| 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 创金合信中证1000增强A | 1,072 | 25,205.09 | 5,000,166.70 | 18.51% | 22,019,684.97 | 81.49% |
| 创金合信中证1000增强C | 812 | 39,304.12 | 12,724,250.12 | 39.87% | 19,190,698.53 | 60.13% |
| 合计 | 1,824 | 32,310.75 | 17,724,416.82 | 30.07% | 41,210,383.50 | 69.93% |

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

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

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

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

**9.4发起式基金发起资金持有份额情况**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
| 基金管理人固有资金 | 10,000,333.36 | 16.97% | 10,000,333.36 | 16.97% | 36月 |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | - |
| 基金经理等人员 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | - |
| 基金管理人股东 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | - |
| 其他 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | - |
| 合计 | 10,000,333.36 | 16.97% | 10,000,333.36 | 16.97% | 36月 |

**§10  开放式基金份额变动**

单位：份

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

**§11  重大事件揭示**

**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

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

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**11.4 基金投资策略的改变**

本报告期内基金投资策略无重大改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

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

注：交易单元的选择标准和程序：  
（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；  
（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；  
（3）经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；  
（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。  
基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。  
本基金本报告期内无交易单元变更。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
| 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 金元证券 | 2,692,640.00 | 16.73% | 25,000,000.00 | 24.15% | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 13,400,879.65 | 83.27% | 78,500,000.00 | 75.85% | - | - | - | - |

**11.8 其他重大事件**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| 1 | 创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告 | 公司官网 | 2018-01-02 |
| 2 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年第4季度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-01-19 |
| 3 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加苏宁金融为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-01-29 |
| 4 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新） | 公司官网、证券时报 | 2018-02-02 |
| 5 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号） | 公司官网、证券时报 | 2018-02-02 |
| 6 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-02-10 |
| 7 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报 | 2018-03-28 |
| 8 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报 | 2018-03-28 |
| 9 | 创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-03-28 |
| 10 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报 | 2018-03-28 |
| 11 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同（2018年3月修订） | 公司官网、证券时报 | 2018-03-28 |
| 12 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-03-29 |
| 13 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-03-30 |
| 14 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-03-31 |
| 15 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要 | 公司官网、证券时报 | 2018-03-31 |
| 16 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券费率优惠活动的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-04-02 |
| 17 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第1季度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-04-19 |
| 18 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-04-27 |
| 19 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-05-17 |
| 20 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与第一创业证券费率优惠活动的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-05-24 |
| 21 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广发证券为代销机构暨参加广发证券费率优惠活动的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-06 |
| 22 | 创金合信基金管理有限公司关于创金合信中证1000指数增强A调整申购金额下限及最低持有金额下限的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-12 |
| 23 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-15 |
| 24 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-21 |
| 25 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-22 |
| 26 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加恒泰证券为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-06-29 |
| 27 | 创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告 | 公司官网 | 2018-07-02 |
| 28 | 创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-07-06 |
| 29 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第2季度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-07-20 |
| 30 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金（2018年第1号）招募说明书（更新） | 公司官网、证券时报 | 2018-08-03 |
| 31 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号） | 公司官网、证券时报 | 2018-08-03 |
| 32 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加长量基金为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-08-10 |
| 33 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加和耕传承为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-08-17 |
| 34 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年半年度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-08-29 |
| 35 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-09-01 |
| 36 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-09-11 |
| 37 | 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年第3季度报告 | 公司官网、证券时报 | 2018-10-25 |
| 38 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加植信基金为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-10-26 |
| 39 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中银国际证券为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-11-13 |
| 40 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加阳光人寿为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-11-29 |
| 41 | 创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加腾安基金为代销机构的公告 | 公司官网、证券时报 | 2018-12-07 |

**§12 影响投资者决策的其他重要信息**

**12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **投资者类别** | 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 - 20180326 | 158,930,244.65 | 0.00 | 158,930,244.65 | 0.00 | 0.00% |
| 2 | 20180208 - 20180327 | 39,847,579.20 | 0.00 | 39,847,579.20 | 0.00 | 0.00% |
| 3 | 20180328 - 20180412,20180828 - 20181114,20181120 - 20181121 | 10,000,333.36 | 0.00 | 0.00 | 10,000,333.36 | 16.97% |
| 4 | 20180328 - 20180708 | 0.00 | 20,839,564.75 | 20,839,564.75 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：  1、大额申购风险  在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。  2、大额赎回风险  （1）若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；  （2）若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；  （3）基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；  （4）因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；  （5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。  本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。 | | | | | | | |

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

**§13  备查文件目录**

**13.1 备查文件目录**

1、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；

3、创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2018年年度报告。

**13.2 存放地点**

深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

**13.3 查阅方式**

www.cjhxfund.com

**创金合信基金管理有限公司**

**二〇一九年三月二十九日**