

---

# 创金合信国证 A 股指数发起式证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信国证A股指数	
基金主代码	005414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月28日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,370,487.12份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信国证A股指 数A	创金合信国证A股指 数C
下属分级基金的交易代码	005414	005415
报告期末下属分级基金的份额总额	5,893,988.12份	5,476,499.00份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

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

#### 2.4 信息披露方式

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

注：本基金自2019年1月19日起信息披露报纸由《中国证券报》、《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
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
本期已实现收益	325,996.62	312,987.35
本期利润	516,063.87	511,272.68
加权平均基金份额本期利润	0.0860	0.0884
本期加权平均净值利润率	8.66%	8.97%
本期基金份额净值增长率	8.49%	8.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	72,140.01	24,116.66
期末可供分配基金份额利润	0.0122	0.0044
期末基金资产净值	6,281,367.62	5,788,757.40
期末基金份额净值	1.0657	1.0570
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.57%	5.70%

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

创金合信国证A股指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
过去一个月	8.31%	0.72%	8.07%	0.79%	0.24%	-0.07%
过去三个月	13.44%	0.88%	14.16%	0.92%	-0.72%	-0.04%
过去六个月	8.49%	1.49%	7.03%	1.52%	1.46%	-0.03%
过去一年	15.30%	1.21%	14.16%	1.23%	1.14%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	6.57%	1.33%	4.26%	1.32%	2.31%	0.01%

## 创金合信国证A股指数C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	8.30%	0.73%	8.07%	0.79%	0.23%	-0.06%
过去三个月	13.39%	0.88%	14.16%	0.92%	-0.77%	-0.04%
过去六个月	8.39%	1.49%	7.03%	1.52%	1.36%	-0.03%
过去一年	15.00%	1.21%	14.16%	1.23%	0.84%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	5.70%	1.33%	4.26%	1.32%	1.44%	0.01%

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2020年6月30日，本公司共管理49只公募基金，其中混合型产品13只、指数型产品5只、债券型产品20只、股票型产品10只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约340.38亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	本基金基金经理	2017-12-28	-	12年	陈龙先生，中国国籍，复旦大学经济学硕士和美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）金融工程硕士。2006年7月就职于中证指数有限公司，任研发部高级研究员。2013年2月加入中国金融期货交易所，任股指期货事业部高级经理，2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部副总监、基金经理。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为国证A股指数，业绩基准为国证A股指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。国证A股指数的样本股为在深圳、上海证券交易所上市的除ST、\*ST股票外的所有A股，于2005年2月3日发布，用以反映中国A股市场股票价格的整体表现。本基金的投资策略，正常情况下，主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信国证A股指数A基金份额净值为1.0657元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.49%，同期业绩比较基准收益率为7.03%；截至报告期末创金合信国证A股指数C基金份额净值为1.0570元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.39%，同期业绩比较基准收益率为7.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年下半年，全球经济呈缓慢复苏状态，主要央行将延续宽松的货币政策。中国国内经济遭受的短暂冲击已经过去，二季度数据显示复苏加快，IMF预测中国是唯一在2020年保持正增长的经济体。国内资本市场方面，各项改革措施加速推进，基本面长期向好，流动性较为充裕，海外增量资金仍然会持续流入。风险方面，全球疫情仍然是最大的不确定性来源，影响各国复产复工进程，同时随着美国大选周期临近，中国的外部政治环境可能面临一定恶化，需要关注短期事件带来的冲击。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	457,679.92	431,952.97
结算备付金		-	28,327.56
存出保证金		637.87	935.70
交易性金融资产	6.4.7.2	11,626,041.63	10,843,789.05
其中：股票投资		11,425,741.63	10,642,289.05
基金投资		-	-
债券投资		200,300.00	201,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,253.80	-
应收利息	6.4.7.5	6,430.55	3,030.10

应收股利		-	-
应收申购款		-	23,264.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,123,043.77	11,331,300.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		18,625.84	35,906.28
应付管理人报酬		5,030.71	4,721.52
应付托管费		1,006.16	944.32
应付销售服务费		998.23	935.81
应付交易费用	6.4.7.7	1,464.20	5,076.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	25,793.61	38,002.70
负债合计		52,918.75	85,586.69
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	11,370,487.12	11,490,400.25
未分配利润	6.4.7.10	699,637.90	-244,686.61
所有者权益合计		12,070,125.02	11,245,713.64
负债和所有者权益总计		12,123,043.77	11,331,300.33

注：报告截止日2020年06月30日，基金份额总额11,370,487.12份，其中下属A类基金份额5,893,988.12份，C类基金份额5,476,499.00份。下属A类基金份额净值1.0657元，C类基金份额净值1.0570元。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
<b>一、收入</b>		1,120,134.59	2,810,683.55
1. 利息收入		5,162.75	6,499.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,701.43	1,529.66
债券利息收入		3,461.32	4,969.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		709,445.63	203,463.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	613,511.89	105,045.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-952.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	95,933.74	99,369.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	388,352.58	2,583,476.24

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,173.63	17,245.01
<b>减：二、费用</b>		92,798.04	88,509.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,906.47	28,976.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,781.33	5,795.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,653.34	5,624.10
4. 交易费用	6.4.7.17	18,053.82	16,587.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.18	34,403.08	31,526.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,027,336.55	2,722,174.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,027,336.55	2,722,174.06

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,490,400.25	-244,686.61	11,245,713.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,027,336.55	1,027,336.55
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)	-119,913.13	-83,012.04	-202,925.17
其中:1.基金申购款	4,307,282.04	-107,099.98	4,200,182.06
2.基金赎回款	-4,427,195.17	24,087.94	-4,403,107.23
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)	11,370,487.12	699,637.90	12,070,125.02
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14,498,044.53	-3,906,907.82	10,591,136.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,722,174.06	2,722,174.06
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)	-1,868,488.23	197,493.32	-1,670,994.91
其中:1.基金申购款	4,178,501.88	-560,343.58	3,618,158.30
2.基金赎回款	-6,046,990.11	757,836.90	-5,289,153.21
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)	12,629,556.30	-987,240.44	11,642,315.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信国证A股指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2125号《关于准予创金合信国证A股指数发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币11,881,532.97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(2017)第1088号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》于2017年12月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,883,173.75份基金份额,其中认购资金利息折合1,640.78份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,001,400.14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《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成分股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：国证A股指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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》、《创金合信国证A股指数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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 and 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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
----	--------------------

活期存款	457,679.92
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	457,679.92

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,236,192.49	11,425,741.63	1,189,549.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	201,580.00	200,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	201,580.00	200,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,437,772.49	11,626,041.63	1,188,269.14

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	43.07
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	-
应收债券利息	6,387.18
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	0.30
合计	6,430.55

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,464.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,464.20

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.53
预提费用	25,793.08
合计	25,793.61

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 创金合信国证A股指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,717,293.78	5,717,293.78
本期申购	1,548,398.46	1,548,398.46
本期赎回(以“-”号填列)	-1,371,704.12	-1,371,704.12
本期末	5,893,988.12	5,893,988.12

##### 6.4.7.9.2 创金合信国证A股指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,773,106.47	5,773,106.47
本期申购	2,758,883.58	2,758,883.58
本期赎回(以“-”号填列)	-3,055,491.05	-3,055,491.05
本期末	5,476,499.00	5,476,499.00

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 创金合信国证A股指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-254,216.36	152,758.71	-101,457.65
本期利润	325,996.62	190,067.25	516,063.87
本期基金份额交易产生的变动数	359.75	-27,586.47	-27,226.72
其中：基金申购款	-13,931.07	-22,213.30	-36,144.37
基金赎回款	14,290.82	-5,373.17	8,917.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,140.01	315,239.49	387,379.50

## 6.4.7.10.2 创金合信国证A股指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信国证A股指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-293,838.70	150,609.74	-143,228.96
本期利润	312,987.35	198,285.33	511,272.68
本期基金份额交易产生的变动数	4,968.01	-60,753.33	-55,785.32
其中：基金申购款	-43,772.63	-27,182.98	-70,955.61
基金赎回款	48,740.64	-33,570.35	15,170.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,116.66	288,141.74	312,258.40

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	1,570.67
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	124.15
其他	6.61
合计	1,701.43

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	9,977,795.63
减：卖出股票成本总额	9,364,283.74
买卖股票差价收入	613,511.89

## 6.4.7.13 衍生工具收益

## 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

## 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	95,933.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	95,933.74

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	388,352.58
——股票投资	389,552.58
——债券投资	-1,200.00
——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	388,352.58

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	16,659.68
转换费收入	513.95
合计	17,173.63

#### 6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	18,053.82
银行间市场交易费用	-
合计	18,053.82

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	17,793.08
信息披露费	-

汇划手续费	610.00
指数使用费	16,000.00
合计	34,403.08

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

创金合信国证A股指数发起式证券投资基金自2020年07月02日起进入清算期；2020年08月05日，披露《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金清算报告》。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	11,670,052.74	96.30%

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	600,919.00	100.00%

## 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	8,417.96	98.30%	3,774.59	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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,906.47	28,976.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,676.65	2,941.11

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,781.33	5,795.28

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C	合计
招商银行	0.00	4.81	4.81
创金合信直销	0.00	4,968.54	4,968.54
合计	0.00	4,973.35	4,973.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C	合计
创金合信直销	0.00	4,355.31	4,355.31
合计	0.00	4,355.31	4,355.31

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

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

创金合信国证A股指数A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,700.14	5,000,700.14
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,700.14	5,000,700.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.84%	74.85%

创金合信国证A股指数C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,700.00	5,000,700.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	5,000,700.00	5,000,700.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	91.31%	84.06%

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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	457,679.92	1,570.67	344,532.59	1,442.54

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
0025	山西	2020	2020	配股	5.00	6.54	720	3,60	4,70	-

00	证券	-06- 29	-07- 10	流通 受限				0.00	8.80	
----	----	------------	------------	----------	--	--	--	------	------	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
002254	泰和 新材	2020-06-29	重大事项 停牌	13.60	2020-07-14	14.96	1,300	14,666.00	17,680.00	-
002819	东方 中科	2020-06-29	重大事项 停牌	25.92	2020-07-08	28.46	300	7,376.00	7,776.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	200,300.00	201,500.00
合计	200,300.00	201,500.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2020年6月30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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年6月30日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.21%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2020年6月30日,本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为12,096,906.53元,超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	457,679.92	-	-	-	457,679.92
存出保证金	637.87	-	-	-	637.87
交易性金融资产	200,300.00	-	-	11,425,741.63	11,626,041.63
应收证券清算款	-	-	-	32,253.80	32,253.80
应收利息	-	-	-	6,430.55	6,430.55
资产总计	658,617.79	-	-	11,464,425.98	12,123,043.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,625.84	18,625.84
应付管理人报酬	-	-	-	5,030.71	5,030.71
应付托管费	-	-	-	1,006.16	1,006.16
应付销售	-	-	-	998.23	998.23

售服务费					
应付交易费用	-	-	-	1,464.20	1,464.20
其他负债	-	-	-	25,793.61	25,793.61
负债总计	-	-	-	52,918.75	52,918.75
利率敏感度缺口	658,617.79	-	-	11,411,507.23	12,070,125.02
上年度末2019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	431,952.97	-	-	-	431,952.97
结算备付金	28,327.56	-	-	-	28,327.56
存出保证金	935.70	-	-	-	935.70
交易性金融资产	201,500.00	-	-	10,642,289.05	10,843,789.05
应收利息	-	-	-	3,030.10	3,030.10
应收申购款	-	-	-	23,264.95	23,264.95
资产总计	662,716.23	-	-	10,668,584.10	11,331,300.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,906.28	35,906.28
应付管理人报酬	-	-	-	4,721.52	4,721.52
应付托管费	-	-	-	944.32	944.32
应付销售服务费	-	-	-	935.81	935.81
应付交易费用	-	-	-	5,076.06	5,076.06
其他负	-	-	-	38,002.70	38,002.70

债					
负债总计	-	-	-	85,586.69	85,586.69
利率敏感度缺口	662,716.23	-	-	10,582,997.41	11,245,713.64

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.66%(2019年12月31日：1.79%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	11,425,741.63	94.66	10,642,289.05	94.63
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	11,425,741.63	94.66	10,642,289.05	94.63

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他条件不变的情况下		
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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	比较基准上涨5%	564,622.70	535,129.63
	比较基准下降5%	-564,622.70	-535,129.63

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为11,421,032.83元，属于第二层次的余额为205,008.80元，无属于第三层次的余额（2019年12月31日：第一层次10,617,161.65元，第二层次226,627.40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2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2019年12月31日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,425,741.63	94.25
	其中：股票	11,425,741.63	94.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	200,300.00	1.65
	其中：债券	200,300.00	1.65
	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	457,679.92	3.78
8	其他各项资产	39,322.22	0.32
9	合计	12,123,043.77	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	170,822.70	1.42
B	采矿业	334,520.30	2.77
C	制造业	6,025,226.78	49.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	238,016.80	1.97
E	建筑业	244,242.40	2.02
F	批发和零售业	344,395.80	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	329,218.00	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	792,864.20	6.57
J	金融业	2,060,360.20	17.07
K	房地产业	360,138.00	2.98
L	租赁和商务服务业	103,087.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	74,420.20	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	52,221.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	20,163.20	0.17
Q	卫生和社会工作	164,792.65	1.37
R	文化、体育和娱乐业	39,597.00	0.33
S	综合	71,655.40	0.59
	合计	11,425,741.63	94.66

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,300	307,020.00	2.54
2	600519	贵州茅台	200	292,576.00	2.42
3	600276	恒瑞医药	2,132	196,783.60	1.63
4	000333	美的集团	2,500	149,475.00	1.24
5	000858	五粮液	800	136,896.00	1.13
6	601166	兴业银行	8,200	129,396.00	1.07
7	002475	立讯精密	1,965	100,902.75	0.84
8	300059	东方财富	4,945	99,889.00	0.83
9	600887	伊利股份	3,100	96,503.00	0.80
10	000651	格力电器	1,700	96,169.00	0.80
11	601390	中国中铁	17,900	89,858.00	0.74
12	601012	隆基股份	2,178	88,709.94	0.73
13	000661	长春高新	200	87,060.00	0.72
14	600690	海尔智家	4,600	81,420.00	0.67
15	002714	牧原股份	990	81,180.00	0.67

16	600030	中信证券	3,000	72,330.00	0.60
17	002024	苏宁易购	8,200	71,914.00	0.60
18	600016	民生银行	12,600	71,442.00	0.59
19	600919	江苏银行	12,600	71,442.00	0.59
20	601688	华泰证券	3,800	71,440.00	0.59
21	601398	工商银行	14,200	70,716.00	0.59
22	600000	浦发银行	6,600	69,828.00	0.58
23	300015	爱尔眼科	1,557	67,651.65	0.56
24	601229	上海银行	8,102	67,246.60	0.56
25	600745	闻泰科技	500	62,975.00	0.52
26	300498	温氏股份	2,880	62,784.00	0.52
27	601336	新华保险	1,400	61,992.00	0.51
28	601888	中国中免	400	61,612.00	0.51
29	600196	复星医药	1,800	60,930.00	0.50
30	601919	中远海控	17,500	60,725.00	0.50
31	000063	中兴通讯	1,500	60,195.00	0.50
32	000776	广发证券	4,200	59,304.00	0.49
33	600028	中国石化	14,300	55,913.00	0.46
34	600183	生益科技	1,900	55,613.00	0.46
35	600837	海通证券	4,300	54,094.00	0.45
36	601288	农业银行	16,000	54,080.00	0.45
37	603906	龙蟠科技	3,400	53,040.00	0.44
38	000913	钱江摩托	3,900	52,533.00	0.44
39	300750	宁德时代	300	52,308.00	0.43
40	000002	万科 A	2,000	52,280.00	0.43
41	600900	长江电力	2,700	51,138.00	0.42
42	600132	重庆啤酒	700	51,100.00	0.42
43	000876	新希望	1,700	50,660.00	0.42
44	002230	科大讯飞	1,350	50,530.50	0.42
45	603712	七一二	1,300	49,894.00	0.41
46	600547	山东黄金	1,340	49,070.80	0.41

47	603456	九洲药业	1,800	48,780.00	0.40
48	601169	北京银行	9,900	48,510.00	0.40
49	300659	中孚信息	800	48,016.00	0.40
50	002243	通产丽星	3,300	47,520.00	0.39
51	603520	司太立	560	47,073.60	0.39
52	600872	中炬高新	800	46,824.00	0.39
53	601211	国泰君安	2,700	46,602.00	0.39
54	600588	用友网络	1,046	46,128.60	0.38
55	000568	泸州老窖	500	45,560.00	0.38
56	002415	海康威视	1,500	45,525.00	0.38
57	300014	亿纬锂能	950	45,457.50	0.38
58	300212	易华录	800	44,800.00	0.37
59	300119	瑞普生物	2,000	44,700.00	0.37
60	002602	世纪华通	2,900	44,399.00	0.37
61	603387	基蛋生物	1,100	44,319.00	0.37
62	603986	兆易创新	180	42,463.80	0.35
63	000027	深圳能源	9,120	42,316.80	0.35
64	600999	招商证券	1,900	41,705.00	0.35
65	600048	保利地产	2,800	41,384.00	0.34
66	600031	三一重工	2,200	41,272.00	0.34
67	603128	华贸物流	7,100	41,251.00	0.34
68	300453	三鑫医疗	2,100	40,824.00	0.34
69	300016	北陆药业	3,300	40,128.00	0.33
70	600309	万华化学	800	39,992.00	0.33
71	300033	同花顺	300	39,924.00	0.33
72	300468	四方精创	1,651	39,128.70	0.32
73	000529	广弘控股	5,300	39,008.00	0.32
74	600340	华夏幸福	1,700	38,862.00	0.32
75	002601	龙蟠佰利	2,100	38,850.00	0.32
76	601009	南京银行	5,300	38,849.00	0.32
77	603609	禾丰牧业	2,600	38,740.00	0.32

78	600895	张江高科	1,900	38,703.00	0.32
79	300552	万集科技	900	38,322.00	0.32
80	601601	中国太保	1,400	38,150.00	0.32
81	002847	盐津铺子	400	38,088.00	0.32
82	300352	北信源	5,400	38,070.00	0.32
83	601668	中国建筑	7,920	37,778.40	0.31
84	601328	交通银行	7,300	37,449.00	0.31
85	002498	汉缆股份	8,000	37,280.00	0.31
86	603308	应流股份	1,800	36,720.00	0.30
87	603229	奥翔药业	700	36,400.00	0.30
88	002531	天顺风能	6,000	35,880.00	0.30
89	002524	光正集团	3,300	35,871.00	0.30
90	603882	金域医学	400	35,800.00	0.30
91	601611	中国核建	5,700	35,226.00	0.29
92	601377	兴业证券	5,100	34,935.00	0.29
93	002031	巨轮智能	18,500	34,595.00	0.29
94	601898	中煤能源	9,000	34,200.00	0.28
95	002926	华西证券	3,200	34,016.00	0.28
96	600993	马应龙	1,400	33,950.00	0.28
97	001872	招商港口	2,300	33,465.00	0.28
98	603258	电魂网络	600	33,336.00	0.28
99	603315	福鞍股份	2,500	32,650.00	0.27
100	603288	海天味业	260	32,344.00	0.27
101	600685	中船防务	1,900	32,129.00	0.27
102	601108	财通证券	3,100	31,775.00	0.26
103	603166	福达股份	5,000	31,750.00	0.26
104	002142	宁波银行	1,200	31,524.00	0.26
105	600510	黑牡丹	3,900	30,732.00	0.25
106	300760	迈瑞医疗	100	30,570.00	0.25
107	300661	圣邦股份	100	30,505.00	0.25
108	600617	国新能源	7,700	30,107.00	0.25

109	601628	中国人寿	1,100	29,931.00	0.25
110	002841	视源股份	300	29,856.00	0.25
111	300253	卫宁健康	1,300	29,822.00	0.25
112	601988	中国银行	8,500	29,580.00	0.25
113	000686	东北证券	3,500	29,575.00	0.25
114	300563	神宇股份	900	29,457.00	0.24
115	002241	歌尔股份	1,000	29,360.00	0.24
116	600728	佳都科技	3,200	29,152.00	0.24
117	600050	中国联通	6,000	29,040.00	0.24
118	002028	思源电气	1,400	28,644.00	0.24
119	002351	漫步者	1,350	28,512.00	0.24
120	002877	智能自控	3,900	28,236.00	0.23
121	000514	渝开发	7,300	27,886.00	0.23
122	000848	承德露露	3,960	27,720.00	0.23
123	300417	南华仪器	1,530	27,662.40	0.23
124	002079	苏州固锔	2,100	27,657.00	0.23
125	000725	京东方 A	5,900	27,553.00	0.23
126	600135	乐凯胶片	4,200	27,468.00	0.23
127	300418	昆仑万维	1,100	27,456.00	0.23
128	603887	城地股份	1,120	27,328.00	0.23
129	300085	银之杰	1,700	27,234.00	0.23
130	002799	环球印务	1,400	27,188.00	0.23
131	002252	上海莱士	3,200	27,072.00	0.22
132	002860	星帅尔	1,700	27,030.00	0.22
133	000001	平安银行	2,100	26,880.00	0.22
134	000729	燕京啤酒	3,900	26,715.00	0.22
135	300502	新易盛	420	26,510.40	0.22
136	600585	海螺水泥	500	26,455.00	0.22
137	002869	金溢科技	400	26,432.00	0.22
138	000977	浪潮信息	672	26,328.96	0.22
139	603385	惠达卫浴	1,900	26,182.00	0.22

140	000708	中信特钢	1,530	26,147.70	0.22
141	600111	北方稀土	2,800	26,096.00	0.22
142	300639	凯普生物	500	25,965.00	0.22
143	000009	中国宝安	3,040	25,870.40	0.21
144	600267	海正药业	1,800	25,830.00	0.21
145	300041	回天新材	1,700	25,789.00	0.21
146	000802	北京文化	4,200	25,746.00	0.21
147	002303	美盈森	5,900	25,665.00	0.21
148	300480	光力科技	1,690	25,535.90	0.21
149	000551	创元科技	2,600	25,532.00	0.21
150	300347	泰格医药	250	25,470.00	0.21
151	002625	光启技术	3,500	25,375.00	0.21
152	603208	江山欧派	260	25,324.00	0.21
153	600693	东百集团	5,100	24,735.00	0.20
154	601857	中国石油	5,900	24,721.00	0.20
155	600606	绿地控股	4,000	24,720.00	0.20
156	300277	海联讯	1,700	24,599.00	0.20
157	600027	华电国际	7,100	24,282.00	0.20
158	603013	亚普股份	1,500	24,180.00	0.20
159	600926	杭州银行	2,700	24,084.00	0.20
160	300440	运达科技	2,400	24,024.00	0.20
161	600018	上港集团	5,700	23,940.00	0.20
162	600143	金发科技	1,800	23,706.00	0.20
163	600848	上海临港	1,100	23,617.00	0.20
164	600908	无锡银行	4,800	23,568.00	0.20
165	603819	神力股份	2,210	23,426.00	0.19
166	300500	启迪设计	1,700	23,341.00	0.19
167	601899	紫金矿业	5,300	23,320.00	0.19
168	000895	双汇发展	500	23,045.00	0.19
169	300001	特锐德	1,100	23,034.00	0.19
170	603797	联泰环保	2,000	22,980.00	0.19

171	600600	青岛啤酒	300	22,950.00	0.19
172	600382	广东明珠	3,500	22,890.00	0.19
173	600613	神奇制药	3,400	22,882.00	0.19
174	002695	煌上煌	900	22,698.00	0.19
175	601677	明泰铝业	2,600	22,568.00	0.19
176	603993	洛阳钼业	6,100	22,387.00	0.19
177	603160	汇顶科技	100	22,290.00	0.18
178	002895	川恒股份	1,800	22,032.00	0.18
179	002182	云海金属	2,300	21,942.00	0.18
180	300003	乐普医疗	600	21,912.00	0.18
181	002352	顺丰控股	400	21,880.00	0.18
182	002879	长缆科技	1,400	21,728.00	0.18
183	000166	申万宏源	4,300	21,715.00	0.18
184	600009	上海机场	300	21,621.00	0.18
185	300043	星辉娱乐	5,400	21,600.00	0.18
186	300235	方直科技	1,300	21,476.00	0.18
187	600218	全柴动力	2,400	21,408.00	0.18
188	002107	沃华医药	1,920	21,312.00	0.18
189	600846	同济科技	2,500	21,250.00	0.18
190	002271	东方雨虹	520	21,127.60	0.18
191	600011	华能国际	5,000	21,100.00	0.17
192	002384	东山精密	700	20,965.00	0.17
193	300701	森霸传感	600	20,898.00	0.17
194	603197	保隆科技	700	20,706.00	0.17
195	300613	富瀚微	180	20,394.00	0.17
196	600603	广汇物流	4,300	20,253.00	0.17
197	300223	北京君正	200	20,188.00	0.17
198	002320	海峡股份	1,800	19,800.00	0.16
199	601818	光大银行	5,500	19,690.00	0.16
200	002928	华夏航空	1,300	19,565.00	0.16
201	603233	大参林	240	19,492.80	0.16

202	600060	海信视像	1,600	19,440.00	0.16
203	000633	合金投资	5,500	19,415.00	0.16
204	002216	三全食品	800	19,120.00	0.16
205	600958	东方证券	2,000	18,980.00	0.16
206	600327	大东方	4,800	18,768.00	0.16
207	603856	东宏股份	1,300	18,720.00	0.16
208	603018	中设集团	1,920	18,681.60	0.15
209	600521	华海药业	550	18,661.50	0.15
210	300541	先进数通	1,040	18,522.40	0.15
211	002500	山西证券	2,820	18,442.80	0.15
212	601881	中国银河	1,600	18,352.00	0.15
213	603123	翠微股份	2,400	18,000.00	0.15
214	600774	汉商集团	1,500	17,880.00	0.15
215	002276	万马股份	2,500	17,850.00	0.15
216	000563	陕国投 A	4,800	17,808.00	0.15
217	600466	蓝光发展	3,300	17,787.00	0.15
218	601633	长城汽车	2,300	17,756.00	0.15
219	002254	泰和新材	1,300	17,680.00	0.15
220	002194	武汉凡谷	840	17,388.00	0.14
221	002925	盈趣科技	300	17,382.00	0.14
222	600438	通威股份	1,000	17,380.00	0.14
223	002236	大华股份	900	17,289.00	0.14
224	603012	创力集团	2,400	17,112.00	0.14
225	002371	北方华创	100	17,091.00	0.14
226	601939	建设银行	2,700	17,037.00	0.14
227	000026	飞亚达	1,900	16,967.00	0.14
228	002745	木林森	1,100	16,951.00	0.14
229	002127	南极电商	800	16,936.00	0.14
230	300283	温州宏丰	4,100	16,892.00	0.14
231	603238	诺邦股份	400	16,880.00	0.14
232	300543	朗科智能	1,190	16,790.90	0.14

233	601138	工业富联	1,100	16,665.00	0.14
234	601607	上海医药	900	16,542.00	0.14
235	600486	扬农化工	200	16,500.00	0.14
236	300487	蓝晓科技	500	16,440.00	0.14
237	300669	沪宁股份	520	16,437.20	0.14
238	601058	赛轮轮胎	4,500	15,885.00	0.13
239	600536	中国软件	200	15,840.00	0.13
240	300142	沃森生物	300	15,708.00	0.13
241	603336	宏辉果蔬	1,305	15,673.05	0.13
242	601969	海南矿业	3,200	15,616.00	0.13
243	002152	广电运通	1,200	15,528.00	0.13
244	600019	宝钢股份	3,400	15,504.00	0.13
245	300602	飞荣达	471	15,458.22	0.13
246	300672	国科微	300	15,423.00	0.13
247	002822	中装建设	1,800	15,408.00	0.13
248	600206	有研新材	1,100	15,367.00	0.13
249	000402	金融街	2,300	15,272.00	0.13
250	002605	姚记科技	400	15,200.00	0.13
251	601228	广州港	5,000	15,200.00	0.13
252	601997	贵阳银行	2,120	15,179.20	0.13
253	300692	中环环保	1,200	15,072.00	0.12
254	300537	广信材料	800	15,016.00	0.12
255	002463	沪电股份	600	14,988.00	0.12
256	600313	农发种业	4,200	14,952.00	0.12
257	300123	亚光科技	1,300	14,911.00	0.12
258	002600	领益智造	1,400	14,882.00	0.12
259	601901	方正证券	2,100	14,868.00	0.12
260	002865	钧达股份	1,100	14,718.00	0.12
261	002634	棒杰股份	2,500	14,675.00	0.12
262	002621	美吉姆	2,380	14,613.20	0.12
263	002049	紫光国微	200	14,550.00	0.12

264	600809	山西汾酒	100	14,500.00	0.12
265	601225	陕西煤业	2,000	14,420.00	0.12
266	002594	比亚迪	200	14,360.00	0.12
267	300327	中颖电子	440	14,256.00	0.12
268	300050	世纪鼎利	2,800	14,168.00	0.12
269	601918	新集能源	5,900	14,042.00	0.12
270	002555	三七互娱	300	14,040.00	0.12
271	600150	中国船舶	800	13,952.00	0.12
272	002909	集泰股份	1,540	13,798.40	0.11
273	300114	中航电测	1,200	13,692.00	0.11
274	603859	能科股份	400	13,664.00	0.11
275	603129	春风动力	200	13,642.00	0.11
276	002568	百润股份	300	13,596.00	0.11
277	300058	蓝色光标	1,700	13,260.00	0.11
278	002205	国统股份	1,440	13,248.00	0.11
279	300021	大禹节水	3,000	13,170.00	0.11
280	002921	联诚精密	600	12,978.00	0.11
281	603737	三棵树	140	12,910.80	0.11
282	000958	东方能源	3,100	12,896.00	0.11
283	601766	中国中车	2,300	12,811.00	0.11
284	600731	湖南海利	1,800	12,780.00	0.11
285	000923	河钢资源	1,000	12,600.00	0.10
286	002578	闽发铝业	3,600	12,564.00	0.10
287	300497	富祥药业	640	12,524.80	0.10
288	600779	水井坊	200	12,484.00	0.10
289	002302	西部建设	1,300	12,480.00	0.10
290	601890	亚星锚链	2,300	12,443.00	0.10
291	300526	中潜股份	100	12,420.00	0.10
292	600984	建设机械	500	12,400.00	0.10
293	600395	盘江股份	2,300	12,305.00	0.10
294	300225	金力泰	1,900	12,293.00	0.10

295	603019	中科曙光	320	12,288.00	0.10
296	600511	国药股份	300	12,201.00	0.10
297	600171	上海贝岭	700	12,166.00	0.10
298	300118	东方日升	800	12,000.00	0.10
299	000622	恒立实业	3,200	11,968.00	0.10
300	603369	今世缘	300	11,937.00	0.10
301	601163	三角轮胎	900	11,916.00	0.10
302	600489	中金黄金	1,300	11,882.00	0.10
303	300737	科顺股份	600	11,838.00	0.10
304	300743	天地数码	700	11,823.00	0.10
305	603679	华体科技	300	11,793.00	0.10
306	002706	良信电器	700	11,676.00	0.10
307	300369	绿盟科技	500	11,645.00	0.10
308	000567	海德股份	900	11,574.00	0.10
309	000961	中南建设	1,300	11,570.00	0.10
310	600217	中再资环	2,400	11,568.00	0.10
311	600058	五矿发展	1,900	11,476.00	0.10
312	002111	威海广泰	800	11,400.00	0.09
313	601330	绿色动力	1,200	11,400.00	0.09
314	002547	春兴精工	1,600	11,392.00	0.09
315	600188	兖州煤业	1,300	11,388.00	0.09
316	002214	大立科技	400	11,272.00	0.09
317	002100	天康生物	700	11,270.00	0.09
318	000983	西山煤电	2,990	11,212.50	0.09
319	002511	中顺洁柔	500	11,150.00	0.09
320	601838	成都银行	1,400	11,144.00	0.09
321	000963	华东医药	440	11,132.00	0.09
322	002066	瑞泰科技	1,100	11,033.00	0.09
323	603005	晶方科技	140	11,012.40	0.09
324	600115	东方航空	2,600	10,972.00	0.09
325	002223	鱼跃医疗	300	10,920.00	0.09

326	603360	百傲化学	560	10,880.80	0.09
327	000488	晨鸣纸业	2,200	10,868.00	0.09
328	603977	国泰集团	1,400	10,864.00	0.09
329	000582	北部湾港	1,000	10,740.00	0.09
330	002397	梦洁股份	1,800	10,728.00	0.09
331	300702	天宇股份	100	10,632.00	0.09
332	002807	江阴银行	2,700	10,611.00	0.09
333	002876	三利谱	200	10,580.00	0.09
334	002690	美亚光电	200	10,520.00	0.09
335	601933	永辉超市	1,100	10,318.00	0.09
336	300628	亿联网络	150	10,239.00	0.08
337	600104	上汽集团	600	10,194.00	0.08
338	002644	佛慈制药	1,200	10,020.00	0.08
339	002432	九安医疗	900	10,017.00	0.08
340	300122	智飞生物	100	10,015.00	0.08
341	601018	宁波港	2,800	9,996.00	0.08
342	603186	华正新材	200	9,954.00	0.08
343	601111	中国国航	1,500	9,915.00	0.08
344	300140	中环装备	1,100	9,878.00	0.08
345	601117	中国化学	1,800	9,864.00	0.08
346	000988	华工科技	400	9,772.00	0.08
347	603036	如通股份	1,100	9,757.00	0.08
348	600963	岳阳林纸	2,730	9,691.50	0.08
349	600612	老凤祥	200	9,638.00	0.08
350	300194	福安药业	1,800	9,558.00	0.08
351	600583	海油工程	2,100	9,555.00	0.08
352	600063	皖维高新	2,900	9,454.00	0.08
353	300303	聚飞光电	1,600	9,424.00	0.08
354	600007	中国国贸	700	9,331.00	0.08
355	600029	南方航空	1,800	9,306.00	0.08
356	002664	长鹰信质	700	9,254.00	0.08

357	600310	桂东电力	2,400	9,216.00	0.08
358	002436	兴森科技	700	8,981.00	0.07
359	601700	风范股份	1,700	8,942.00	0.07
360	600208	新湖中宝	3,000	8,940.00	0.07
361	600578	京能电力	3,000	8,790.00	0.07
362	601619	嘉泽新能	3,000	8,760.00	0.07
363	603198	迎驾贡酒	400	8,708.00	0.07
364	002299	圣农发展	300	8,700.00	0.07
365	002013	中航机电	1,100	8,690.00	0.07
366	603858	步长制药	300	8,655.00	0.07
367	600015	华夏银行	1,400	8,568.00	0.07
368	300404	博济医药	520	8,439.60	0.07
369	600346	恒力石化	600	8,400.00	0.07
370	601319	中国人保	1,300	8,372.00	0.07
371	002328	新朋股份	1,400	8,190.00	0.07
372	601872	招商轮船	1,400	8,162.00	0.07
373	002191	劲嘉股份	900	8,019.00	0.07
374	600517	国网英大	1,200	8,016.00	0.07
375	600025	华能水电	2,100	7,959.00	0.07
376	002429	兆驰股份	1,600	7,920.00	0.07
377	002139	拓邦股份	1,400	7,882.00	0.07
378	601066	中信建投	200	7,876.00	0.07
379	300062	中能电气	1,500	7,875.00	0.07
380	603063	禾望电气	1,100	7,832.00	0.06
381	002734	利民股份	520	7,784.40	0.06
382	002819	东方中科	300	7,776.00	0.06
383	002657	中科金财	500	7,765.00	0.06
384	002048	宁波华翔	500	7,720.00	0.06
385	300682	朗新科技	450	7,659.00	0.06
386	601618	中国中冶	3,000	7,530.00	0.06
387	002065	东华软件	600	7,512.00	0.06

388	603920	世运电路	300	7,437.00	0.06
389	002818	富森美	600	7,380.00	0.06
390	300686	智动力	300	7,218.00	0.06
391	000791	甘肃电投	2,300	7,107.00	0.06
392	000157	中联重科	1,100	7,073.00	0.06
393	601021	春秋航空	200	7,048.00	0.06
394	300551	古鳌科技	360	6,814.80	0.06
395	300215	电科院	1,100	6,798.00	0.06
396	300096	易联众	800	6,776.00	0.06
397	600704	物产中大	1,600	6,736.00	0.06
398	000400	许继电气	500	6,600.00	0.05
399	600710	苏美达	1,500	6,510.00	0.05
400	002146	荣盛发展	800	6,480.00	0.05
401	600795	国电电力	3,500	6,475.00	0.05
402	300066	三川智慧	1,300	6,396.00	0.05
403	300559	佳发教育	300	6,366.00	0.05
404	600886	国投电力	800	6,288.00	0.05
405	300234	开尔新材	1,088	6,277.76	0.05
406	603699	纽威股份	400	6,232.00	0.05
407	002639	雪人股份	900	6,210.00	0.05
408	300593	新雷能	400	6,192.00	0.05
409	300236	上海新阳	100	6,006.00	0.05
410	002785	万里石	400	5,916.00	0.05
411	300213	佳讯飞鸿	900	5,805.00	0.05
412	002958	青农商行	1,300	5,759.00	0.05
413	600917	重庆燃气	800	5,712.00	0.05
414	600136	当代文体	700	5,712.00	0.05
415	002755	奥赛康	300	5,670.00	0.05
416	002736	国信证券	500	5,650.00	0.05
417	601006	大秦铁路	800	5,632.00	0.05
418	300371	汇中股份	400	5,568.00	0.05

419	002607	中公教育	200	5,550.00	0.05
420	000025	特力A	300	5,499.00	0.05
421	600732	爱旭股份	500	5,395.00	0.04
422	600362	江西铜业	400	5,384.00	0.04
423	603026	石大胜华	200	5,338.00	0.04
424	000425	徐工机械	900	5,319.00	0.04
425	002221	东华能源	600	5,274.00	0.04
426	601808	中海油服	400	5,256.00	0.04
427	000957	中通客车	800	5,208.00	0.04
428	300259	新天科技	900	5,202.00	0.04
429	002851	麦格米特	200	5,184.00	0.04
430	002465	海格通信	400	5,176.00	0.04
431	603990	麦迪科技	100	5,119.00	0.04
432	600352	浙江龙盛	400	5,116.00	0.04
433	601811	新华文轩	500	5,085.00	0.04
434	300192	科斯伍德	300	5,064.00	0.04
435	002119	康强电子	400	4,956.00	0.04
436	002792	通宇通讯	200	4,916.00	0.04
437	600422	昆药集团	500	4,880.00	0.04
438	000069	华侨城A	800	4,848.00	0.04
439	000810	创维数字	400	4,832.00	0.04
440	000750	国海证券	1,090	4,730.60	0.04
441	600176	中国巨石	500	4,575.00	0.04
442	601139	深圳燃气	700	4,550.00	0.04
443	300179	四方达	800	4,536.00	0.04
444	000671	阳光城	700	4,438.00	0.04
445	601231	环旭电子	200	4,368.00	0.04
446	000601	韶能股份	800	4,216.00	0.03
447	002801	微光股份	100	4,195.00	0.03
448	300205	天喻信息	400	4,160.00	0.03
449	603045	福达合金	300	4,149.00	0.03

450	600222	太龙药业	700	4,130.00	0.03
451	300130	新国都	300	4,125.00	0.03
452	000738	航发控制	300	4,095.00	0.03
453	601966	玲珑轮胎	200	4,040.00	0.03
454	000812	陕西金叶	1,400	3,976.00	0.03
455	002340	格林美	800	3,976.00	0.03
456	002166	莱茵生物	500	3,965.00	0.03
457	002027	分众传媒	700	3,899.00	0.03
458	002105	信隆健康	700	3,787.00	0.03
459	601128	常熟银行	500	3,755.00	0.03
460	002326	永太科技	300	3,678.00	0.03
461	600339	中油工程	1,600	3,632.00	0.03
462	300393	中来股份	540	3,607.20	0.03
463	002157	正邦科技	200	3,496.00	0.03
464	300384	三联虹普	200	3,496.00	0.03
465	300363	博腾股份	100	3,456.00	0.03
466	000060	中金岭南	900	3,348.00	0.03
467	300748	金力永磁	100	3,338.00	0.03
468	300731	科创新源	100	3,300.00	0.03
469	001979	招商蛇口	200	3,288.00	0.03
470	002300	太阳电缆	500	3,240.00	0.03
471	603368	柳药股份	140	3,213.00	0.03
472	002458	益生股份	210	3,206.70	0.03
473	002796	世嘉科技	150	3,172.50	0.03
474	600729	重庆百货	100	3,122.00	0.03
475	300680	隆盛科技	180	3,083.40	0.03
476	002739	万达电影	200	3,054.00	0.03
477	600259	广晟有色	100	3,000.00	0.02
478	000586	汇源通信	300	2,841.00	0.02
479	601989	中国重工	700	2,800.00	0.02
480	300664	鹏鹞环保	300	2,769.00	0.02

481	603579	荣泰健康	100	2,682.00	0.02
482	300697	电工合金	200	2,662.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	212,635.00	1.89
2	000661	长春高新	143,223.00	1.27
3	601390	中国中铁	89,021.00	0.79
4	002024	苏宁易购	88,219.00	0.78
5	603986	兆易创新	88,169.00	0.78
6	300661	圣邦股份	80,915.00	0.72
7	600919	江苏银行	74,663.00	0.66
8	600745	闻泰科技	71,780.00	0.64
9	600690	海尔智家	62,983.00	0.56
10	601919	中远海控	61,273.00	0.54
11	300659	中孚信息	58,729.00	0.52
12	603160	汇顶科技	58,000.00	0.52
13	000776	广发证券	57,894.00	0.51
14	600276	恒瑞医药	54,264.00	0.48
15	600028	中国石化	52,891.00	0.47
16	000027	深圳能源	52,452.00	0.47
17	000802	北京文化	51,800.00	0.46
18	603005	晶方科技	51,080.00	0.45
19	601336	新华保险	49,989.00	0.44
20	600135	乐凯胶片	47,945.00	0.43

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	220,690.00	1.96
2	000661	长春高新	95,834.00	0.85
3	603986	兆易创新	82,685.00	0.74
4	300661	圣邦股份	79,641.00	0.71
5	300454	深信服	56,854.00	0.51
6	002607	中公教育	55,256.00	0.49
7	601318	中国平安	54,962.00	0.49
8	000001	平安银行	50,622.00	0.45
9	601766	中国中车	47,881.00	0.43
10	000750	国海证券	43,609.00	0.39
11	600104	上汽集团	42,995.00	0.38
12	600585	海螺水泥	42,513.00	0.38
13	002916	深南电路	42,335.20	0.38
14	000338	潍柴动力	41,928.00	0.37
15	603444	吉比特	41,254.00	0.37
16	000700	模塑科技	40,350.00	0.36
17	603005	晶方科技	38,619.00	0.34
18	603501	韦尔股份	37,672.00	0.33
19	000725	京东方 A	37,557.00	0.33
20	000651	格力电器	37,423.00	0.33

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,758,183.74
卖出股票收入（成交）总额	9,977,795.63

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,300.00	1.66
	其中：政策性金融债	200,300.00	1.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,300.00	1.66

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018007	国开1801	2,000	200,300.00	1.66

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	637.87
2	应收证券清算款	32,253.80
3	应收股利	-
4	应收利息	6,430.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,322.22

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
创金 合信 国证A 股指 数A	224	26,312.45	5,000,700.14	84.8 4%	893,287.98	15.16%
创金 合信 国证A 股指 数C	132	41,488.63	5,000,700.00	91.3 1%	475,799.00	8.69%
合计	342	33,247.04	10,001,400.14	87.9	1,369,086.98	12.04%

				6%		
--	--	--	--	----	--	--

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信国证A股指数A	9,976.55	0.17%
	创金合信国证A股指数C	2,662.84	0.05%
	合计	12,639.39	0.11%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	创金合信国证A股 指数A	0
	创金合信国证A股 指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	创金合信国证A股 指数A	0
	创金合信国证A股 指数C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发 起 份 额 承 诺 持

					有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	87.96%	10,001,400.14	87.96%	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	10,001,400.14	87.96%	10,001,400.14	87.96%	36月

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
基金合同生效日(2017年12月28日)基金份额总额	5,944,930.98	5,938,242.77
本报告期期初基金份额总额	5,717,293.78	5,773,106.47
本报告期基金总申购份额	1,548,398.46	2,758,883.58
减：本报告期基金总赎回份额	1,371,704.12	3,055,491.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,893,988.12	5,476,499.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2020年06月30日表决通过了《关于终止创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	
英大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	19,237,535.99	97.51%	6,166.05	97.53%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
光大	2	-	-	-	-	-

证券						
广发证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	450,368.20	2.28%	143.33	2.27%	-
中信建投证券	2	41,302.44	0.21%	12.86	0.20%	-

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。

本基金本报告期内停用广发证券的2个交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2019年第四季度报告	公司官网、上海证券报	2020-01-17
2	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2020年第一季度报告	公司官网、上海证券报	2020-04-21

3	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2019年年度报告	公司官网、上海证券报	2020-04-30
4	创金合信国证A股指数发起式证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	公司官网、上海证券报	2020-05-29
5	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告	公司官网、上海证券报	2020-05-29
6	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	公司官网、上海证券报	2020-05-30
7	创金合信基金管理有限公司关于以通讯方式召开创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	公司官网、上海证券报	2020-06-01

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101 - 20200630	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	87.96%

#### 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) 若本基金在短期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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信国证A股指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信国证A股指数发起式证券投资基金2020年中期报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日