
创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金

2020 年年度报告

2020 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2020年01月01日起至2020年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	82
§10 开放式基金份额变动.....	83
§11 重大事件揭示.....	83
11.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
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.....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
11.8 其他重大事件.....	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§13 备查文件目录.....	90
13.1 备查文件目录.....	90
13.2 存放地点.....	90
13.3 查阅方式.....	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数	
基金主代码	005567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月07日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	24,801,956.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
下属分级基金的交易代码	005567	005568
报告期末下属分级基金的份额总额	15,655,961.27份	9,145,994.79份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838944	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	缪建民	

2.4 信息披露方式

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

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	2020年		2019年		2018年02月07日（基金合同生效日）-2018年12月31日	
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
本期已实现收益	4,706,66 4.38	1,722,66 8.23	6,016,45 8.33	1,881,73 8.94	-2,398,7 82.09	-705,60 6.51
本期利润	7,351,83 2.45	2,542,37 0.56	21,743,1 41.49	7,142,38 4.29	-15,628, 792.24	-3,873,8 08.29
加权平均基金份额本期利润	0.1920	0.1505	0.3382	0.3402	-0.2262	-0.2240
本期加权平均净值利润率	16.67%	12.97%	34.05%	34.16%	-24.96%	-24.95%
本期基金份额净值增长率	35.16%	34.88%	39.95%	39.63%	-21.10%	-21.27%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	3,510,24 8.56	1,978,22 3.48	4,067,01 9.03	708,401. 05	-13,448, 813.18	-3,950,7 70.04
期末可	0.2242	0.2163	0.0489	0.0445	-0.2110	-0.2127

供分配 基金份额 利润						
期末基 金资产 净值	23,364,45 5.59	13,561,0 74.75	91,772,2 75.20	17,508,5 31.87	50,286,7 84.20	14,620,6 24.84
期末基 金份额 净值	1.4924	1.4827	1.1042	1.0993	0.7890	0.7873
3.1.3 累 计期末 指标	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份 额累计 净值增 长率	49.24%	48.27%	10.42%	9.93%	-21.10%	-21.27%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信MSCI中国A股国际指数A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	12.93%	0.95%	16.90%	1.09%	-3.97%	-0.14%
过去六个月	25.86%	1.27%	32.16%	1.38%	-6.30%	-0.11%
过去一年	35.16%	1.36%	37.63%	1.50%	-2.47%	-0.14%

自基金合同生效起至今	49.24%	1.26%	20.26%	1.40%	28.98%	-0.14%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

创金合信MSCI中国A股国际指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.86%	0.95%	16.90%	1.09%	-4.04%	-0.14%
过去六个月	25.73%	1.27%	32.16%	1.38%	-6.43%	-0.11%
过去一年	34.88%	1.36%	37.63%	1.50%	-2.75%	-0.14%
自基金合同生效起至今	48.27%	1.26%	20.26%	1.40%	28.01%	-0.14%

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

创金合信MSCI中国A股国际指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月07日-2020年12月31日)

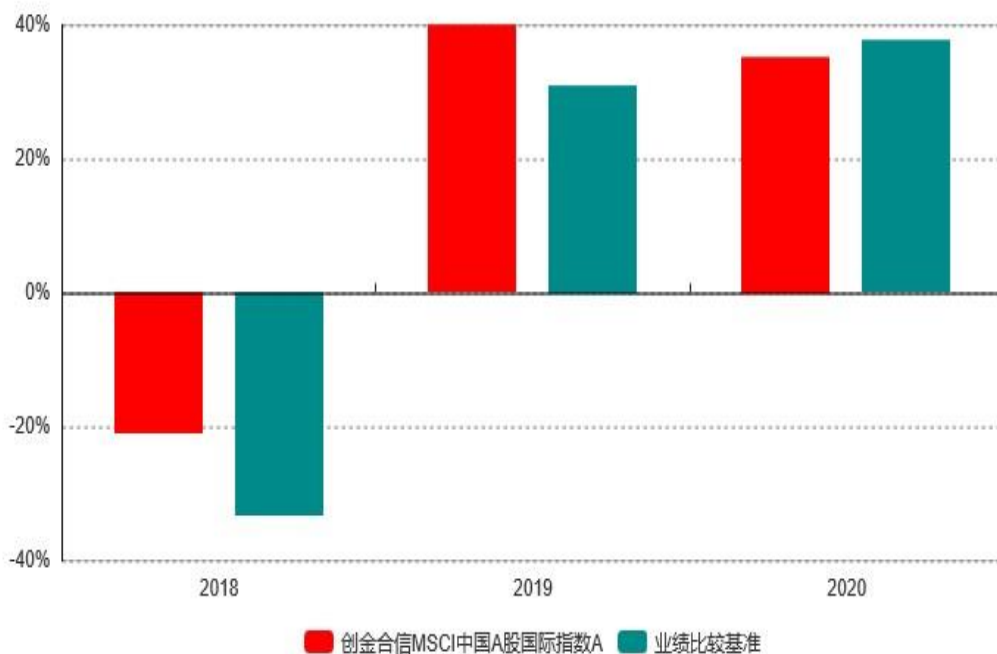


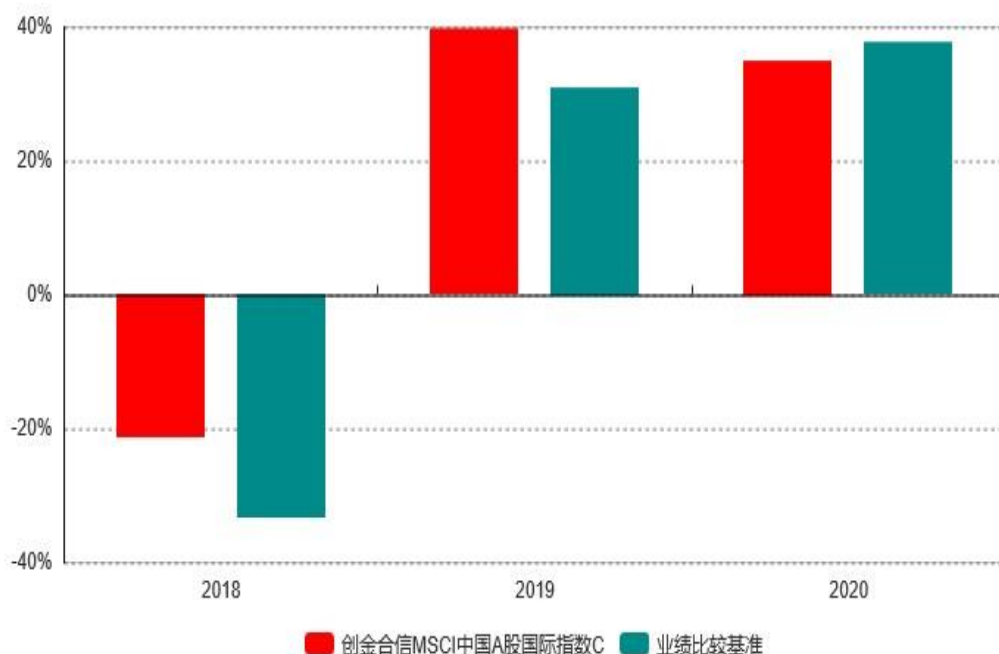
创金合信MSCI中国A股国际指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月07日-2020年12月31日)



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(2018年02月07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20只公募基金。截至2020年12月31日，本公司共管理61只公募基金，其中混合型产品16只、指数型产品5只、债券型产品22只、股票型产品17只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约436.47亿元。

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		
陈龙	本基金基金经理	2018-02-07	2020-07-07	13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，曾任量化指数与国际部副总监、创金合信国证A股指数发起式证券投资基金基金经理（2017年12月28日至2020年7月1日），创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理（2018年2月7日至2020年7月7日），创金合信国证1000指数发起式证券投资基金基金经理（2018年2月7日至2020年7月1日），创金合信国证2000指数发起式证券投资

					基金基金经理 (2018年2月7日至2020年7月1日)，创金合信中证红利低波动指数发起式证券投资基金基金经理 (2018年4月26日至2020年7月7日)。
孙雨	本基金基金经理	2020-01-16	2020-05-14	4年	孙雨先生，中国国籍，中央财经大学硕士，2014年7月加入深圳证券交易所信息管理部（金融创新实验室）从事证券市场研究工作。2016年11月加入创金合信基金管理有限公司，曾任产品经理、基金经理助理、创金合信中证红利低波动指数发起式证券投资基金基金经理 (2020年1月16日至2020年5月14日)，创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理 (2020年1月16日至2020年5月14日)。
王林峰	本基金基金经理	2020-07-07	-	8年	王林峰先生，中山大学硕士，国籍：中国。2012年7月加入国元证券经纪（香港）有限公司，担任研究部分析师。2015年5月加入国元资产管理（香港）有限公司，历任资产管理部研究员、投资经理。2018年10月加入创金合信基金管理有限公司，曾任研究员，现任基金经理。

孙悦	本基金基金经理	2020-09-09	-	3年	孙悦先生，中国国籍，北京大学金融硕士，2017年7月加入创金合信基金管理有限公司，历任量化指数与国际部研究员、投资经理，现任基金经理。
----	---------	------------	---	----	---

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》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与异常交易管理制度》，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

所有投资对象的交易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，合规与风险管理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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为MSCI中国A股国际指数，业绩基准为MSCI中国A股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。MSCI中国A股国际指数是MSCI专为境外投资者投资A股而编制的基准和投资标的，考虑了境外投资者投资A股的相关限制

（外资投资比例）和流动性因素（换手率等指标），入选的样本股主要为大中盘股票，其总市值和自由流通市值占A股整体比例均约为60%左右。本基金的投资策略，正常情况下主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.20%以内；为了更好地实现投资目标，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合。

报告期内基金运作平稳，日均偏离度和年化跟踪误差均控制在合同约定的范围内，误差主要来源于基金申购的新股上市后涨幅较大导致的收益偏离和每日基金申赎导致仓位变化。基金取得了一定的超额收益，主要来源于新股收益和指数成分股分红。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数A基金份额净值为1.4924元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为35.16%，同期业绩比较基准收益率为37.63%；截至报告期末创金合信MSCI中国A股国际指数C基金份额净值为1.4827元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为34.88%，同期业绩比较基准收益率为37.63%。

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年末，由于气温降低、国外疫情防控不力、病毒变异等因素，海外疫情出现大幅反弹，国内亦出现零星病例，进入2021年后，随着疫苗逐渐大面积接种和气温转暖，上半年疫情应该呈现逐渐好转的态势，有利于经济活动的正常开展。国内宏观政策方面，中央经济工作会议定调2021年政策保持连续性、稳定性、不急转弯。当前A股整体估值合理偏高，流动性是短期内压制估值的决定性因素，而企业盈利将随着经济复苏进一步改善，综合判断市场整体大概率呈现窄幅震荡的结构性行情。

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。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《公平交易与异常交易管理制度》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

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 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	带强调事项段的无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第24964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MSCI中国A股国际指数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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“创金合信MSCI中国A股国际指数基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动

	<p>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MSCI中国A股国际指数基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信MSCI中国A股国际指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注,如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述,创金合信MSCI中国A股国际指数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”)拟在资产负债表日后清算创金合信MSCI中国A股国际指数基金的剩余资产。因此,上述创金合信MSCI中国A股国际指数基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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MSCI中国A股国际指数基金</p>

	<p>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MSCI中国A股国际指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注7.4.2有关以清算基础编制财务报表的说明。基金管理人治理层负责监督创金合信MSCI中国A股国际指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对创金合信MSCI中国A股国际指数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</p>

	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。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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	郭素宏、李崇
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	2021-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,163,227.86	4,777,818.20
结算备付金		19,011.27	1,097,539.98
存出保证金		8,007.85	177,463.73
交易性金融资产	7.4.7.2	35,844,393.77	104,361,102.37
其中：股票投资		34,844,493.77	102,517,377.37
基金投资		-	-
债券投资		999,900.00	1,843,725.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	22,137.89	28,480.30
应收股利		-	-
应收申购款		33,676.32	62,677.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		37,090,454.96	110,505,081.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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		54,040.37	892,002.73
应付管理人报酬		15,037.01	64,765.59
应付托管费		3,007.38	12,953.15
应付销售服务费		2,181.96	8,435.68
应付交易费用	7.4.7.7	3,199.04	128,370.08
应交税费		-	657.64
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	87,458.86	117,089.77
负债合计		164,924.62	1,224,274.64
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	24,801,956.06	99,039,630.47
未分配利润	7.4.7.10	12,123,574.28	10,241,176.60

所有者权益合计		36,925,530.34	109,280,807.07
负债和所有者权益总计		37,090,454.96	110,505,081.71

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额总额24,801,956.06份，其中下属A类基金份额15,655,961.27份，C类基金份额9,145,994.79份。下属A类基金份额净值1.4924元，C类基金份额净值1.4827元。

7.2 利润表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		10,781,892.24	30,000,429.64
1. 利息收入		68,437.48	119,478.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,174.74	28,342.45
债券利息收入		47,262.74	91,135.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,133,404.41	8,774,317.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,725,320.24	7,161,353.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-11,563.57	-19,639.04
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	-364,165.63	253,223.31
股利收益	7.4.7.15	783,813.37	1,379,379.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,464,870.40	20,987,328.51
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	115,179.95	119,305.45
减：二、费用		887,689.23	1,114,903.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	322,103.92	418,757.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	64,420.59	83,751.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	39,094.45	41,309.91
4. 交易费用	7.4.7.18	346,747.09	421,933.97
5. 利息支出		76.07	5,714.50
其中：卖出回购金融资产支出		76.07	5,714.50
6. 税金及附加		312.67	911.60
7. 其他费用	7.4.7.19	114,934.44	142,524.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,894,203.01	28,885,525.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,894,203.01	28,885,525.78

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年01月01日至2020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)	99,039,630.47	10,241,176.60	109,280,807.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,894,203.01	9,894,203.01
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)	-74,237,674.41	-8,011,805.33	-82,249,479.74
其中：1. 基金申购款	52,892,858.72	6,151,717.27	59,044,575.99
2. 基金赎回款	-127,130,533.13	-14,163,522.60	-141,294,055.73
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)	24,801,956.06	12,123,574.28	36,925,530.34
项目	上年度可比期间		
	2019年01月01日至2019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)	82,306,992.26	-17,399,583.22	64,907,409.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,885,525.78	28,885,525.78

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）	16,732,638.21	-1,244,765.96	15,487,872.25
其中：1. 基金申购款	138,542,867.69	4,578,554.88	143,121,422.57
2. 基金赎回款	-121,810,229.48	-5,823,320.84	-127,633,550.32
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）	99,039,630.47	10,241,176.60	109,280,807.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

沈琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2442号《关于准予创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币68,365,796.39元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为68,378,462.98份基金份

额，其中认购资金利息折合12,666.59份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,900.09份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成分股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成分股及备选成分股的比例不低于基金资产的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金将持有不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：MSCI中国A股国际指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》以及基金管理人创金合信基金管理有限公司于2021年2月8日发布的《关于创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2021年2月23日进入财产清算期，详情参见附注7.4.8.2资产负债表日后事项，因此本基金财务

报表以清算基础编制。于2020年12月31日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

7.4.3 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。

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。

于本报告期内及上年度可比期间，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。于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

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确认。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确认，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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；(6) 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，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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日

在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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[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和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	1,163,227.86	4,777,818.20
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,163,227.86	4,777,818.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		26,790,906.79	34,844,493.77	8,053,586.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	999,500.00	999,900.00	400.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	999,500.00	999,900.00	400.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		27,790,406.79	35,844,393.77	8,053,986.98
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		97,949,027.76	102,517,377.37	4,568,349.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,842,818.03	1,843,725.00	906.97
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,842,818.03	1,843,725.00	906.97
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		99,791,845.79	104,361,102.37	4,569,256.58

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日			
		合同/名义金额	公允价值		备注
			资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末2019年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,215,060.00	-	-	-
股指期货	1,215,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,215,060.00	-	-	-

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

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	118.49	1,166.73
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	8.59	515.19
应收债券利息	22,006.85	26,771.65
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3.96	26.73
合计	22,137.89	28,480.30

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,199.04	128,370.08
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,199.04	128,370.08

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	40.50	77.12
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	87,418.36	117,012.65
合计	87,458.86	117,089.77

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 创金合信MSCI中国A股国际指数A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	83,112,702.25	83,112,702.25
本期申购	6,565,013.18	6,565,013.18
本期赎回(以“-”号填列)	-74,021,754.16	-74,021,754.16
本期末	15,655,961.27	15,655,961.27

7.4.7.9.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A股国际 指数C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,926,928.22	15,926,928.22
本期申购	46,327,845.54	46,327,845.54
本期赎回(以“-”号填列)	-53,108,778.97	-53,108,778.97
本期末	9,145,994.79	9,145,994.79

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MSCI中国A股国际指数A

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,067,019.03	4,592,553.92	8,659,572.95
本期利润	4,706,664.38	2,645,168.07	7,351,832.45
本期基金份额交易产生的变动数	-5,263,434.85	-3,039,476.23	-8,302,911.08
其中：基金申购款	727,961.06	553,234.12	1,281,195.18

基金赎回款	-5,991,395.91	-3,592,710.35	-9,584,106.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,510,248.56	4,198,245.76	7,708,494.32

7.4.7.10.2 创金合信MSCI中国A股国际指数C

单位：人民币元

项目 (创金合信MSCI中国A 股国际指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	708,401.05	873,202.60	1,581,603.65
本期利润	1,722,668.23	819,702.33	2,542,370.56
本期基金份额交易产生的变动数	-452,845.80	743,951.55	291,105.75
其中：基金申购款	3,266,282.13	1,604,239.96	4,870,522.09
基金赎回款	-3,719,127.93	-860,288.41	-4,579,416.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,978,223.48	2,436,856.48	4,415,079.96

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间2019年01月 01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	14,456.17	20,313.55
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	5,919.88	7,812.29
其他	798.69	216.61
合计	21,174.74	28,342.45

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年01月01日至2020年 12月31日	2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	202,215,675.29	190,940,925.78
减：卖出股票成本总额	195,490,355.05	183,779,571.95
买卖股票差价收入	6,725,320.24	7,161,353.83

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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	-11,563.57	-19,639.04
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	-11,563.57	-19,639.04

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 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	2,202,031.38	8,177,467.03
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	2,143,073.03	7,979,635.04
减：应收利息总额	70,521.92	217,471.03

买卖债券差价收入	-11,563.57	-19,639.04
----------	------------	------------

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2019年01月01日至2019年 12月31日
期货投资	-364,165.63	253,223.31

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	783,813.37	1,379,379.34
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	783,813.37	1,379,379.34

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	3,484,730.40	20,920,668.51
——股票投资	3,485,237.37	20,924,565.74
——债券投资	-506.97	-3,897.23
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2. 衍生工具	-19,860.00	66,660.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-19,860.00	66,660.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,464,870.40	20,987,328.51

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	115,104.47	116,852.57
转换费收入	75.48	2,452.88
合计	115,179.95	119,305.45

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	346,182.21	421,756.04
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	564.88	177.93
合计	346,747.09	421,933.97

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年01月01日至2020年 12月31日	2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,371.50	4,835.99
指数使用费	28,562.94	27,688.88
合计	114,934.44	142,524.87

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

根据《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》以及基金管理人创金合信基金管理有限公司于2021年2月8日发布的《关于创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2021年2月23日进入财产清算程序。

7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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
中国交通建设股份有限公司（“中国交建”）	基金托管人的股东
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。

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	-	-	119,514,467.80	30.69%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	8,658,831.97	73.54%

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	-	-	6,300,000.00	15.79%

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 2020年01月01日至2020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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	86,365.88	47.51%	48,952.50	38.13%

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 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	322,103.92	418,757.45
其中：支付销售机构的客户维护费	100,075.34	166,063.26

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	64,420.59	83,751.56

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。

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 2020年01月01日至2020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MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	6,257.41	6,257.41
第一创业证券	0.00	316.12	316.12
创金合信直销	0.00	12,866.47	12,866.47
合计	0.00	19,440.00	19,440.00
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C	合计
招商银行	0.00	8,115.55	8,115.55
第一创业证券	0.00	175.50	175.50
创金合信直销	0.00	19,344.83	19,344.83
合计	0.00	27,635.88	27,635.88

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

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

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。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的转融通出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的转融通出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信MSCI中国A股国际指数A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.94%	6.02%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至 2020年12月31日	2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.67%	31.40%

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年01月01日至2020年12月31日		2019年01月01日至2019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
招商银行股份有限公司	1,163,227.86	14,456.17	4,777,818.20	20,313.55

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2020年12月31日，本基金持有16,690.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币549,830.51元，估值总额为733,525.50元，占基金资产净值比例为1.99%；本基金持有3,800.00股中国交建A股普通股，成本总额为人民币31,979.74元，估值总额为27,588.00元，占基金资产净值比例为0.07%；持有3,400.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币25,564.71元，估值总额为33,830.00元，占基金资产净值比例为0.09%（2019年12

月31日：本基金持有69,790.00股招商银行A股普通股，成本总额为人民币2,511,417.42元，估值总额为2,622,708.20元，占基金资产净值比例为2.40%；持有12,100.00股第一创业A股普通股，成本总额为人民币99,338.50元，估值总额为100,188.00元，占基金资产净值比例为0.09%）。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2020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：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
600919	江苏银行	2020-12-17	2021-01-14	配股未上市	4.59	5.46	2,790	12,806.10	15,233.40	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	253	4,288.35	4,288.35	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	234	3,573.18	3,573.18	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2020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2020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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、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。

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。

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-

未评级	999,900.00	-
合计	999,900.00	-

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	1,843,725.00
合计	-	1,843,725.00

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2020年12月31日，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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，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2020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0.06%。

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37,040,209.87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、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,163,227.86	-	-	-	1,163,227.86
结算备付金	19,011.27	-	-	-	19,011.27
存出保证金	8,007.85	-	-	-	8,007.85
交易性金融资产	999,900.00	-	-	34,844,493.77	35,844,393.77
应收利息	-	-	-	22,137.89	22,137.89
应收申购款	-	-	-	33,676.32	33,676.32
资产总计	2,190,146.98	-	-	34,900,307.98	37,090,454.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,040.37	54,040.37
应付管理人报酬	-	-	-	15,037.01	15,037.01
应付托管费	-	-	-	3,007.38	3,007.38
应付销售服务费	-	-	-	2,181.96	2,181.96
应付交易费用	-	-	-	3,199.04	3,199.04
其他负债	-	-	-	87,458.86	87,458.86
负债总计	-	-	-	164,924.62	164,924.62
利率敏感度缺口	2,190,146.98	-	-	34,735,383.36	36,925,530.34

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	4,777,818.20	-	-	-	4,777,818.20
结算备付金	1,097,539.98	-	-	-	1,097,539.98
存出保证金	177,463.73	-	-	-	177,463.73
交易性金融资产	1,843,725.00	-	-	102,517,377.37	104,361,102.37
应收利息	-	-	-	28,480.30	28,480.30
应收申购款	-	-	-	62,677.13	62,677.13
资产总计	7,896,546.91	-	-	102,608,534.80	110,505,081.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	892,002.73	892,002.73
应付管理人报酬	-	-	-	64,765.59	64,765.59
应付托管费	-	-	-	12,953.15	12,953.15
应付销售服务费	-	-	-	8,435.68	8,435.68
应付交易费用	-	-	-	128,370.08	128,370.08
应交税费	-	-	-	657.64	657.64
其他负债	-	-	-	117,089.77	117,089.77
负债总计	-	-	-	1,224,274.64	1,224,274.64
利率敏感度缺口	7,896,546.91	-	-	101,384,260.16	109,280,807.07

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2020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2.71%(2019年12月31日: 1.69%), 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)。

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 2020年12月31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	34,844,493.77	94.36	102,517,377.37	93.81
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	34,844,493.77	94.36	102,517,377.37	93.81

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	比较基准上涨5%	1,776,133.69	5,161,608.04
	比较基准下降5%	-1,776,133.69	-5,161,608.04

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2020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34,821,398.84元，属于第二层次的余额为1,022,994.93元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次100,086,927.58元，第二层次4,274,174.79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(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。

§ 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	34,844,493.77	93.94
	其中：股票	34,844,493.77	93.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	999,900.00	2.70
	其中：债券	999,900.00	2.70
	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	1,182,239.13	3.19
8	其他各项资产	63,822.06	0.17
9	合计	37,090,454.96	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	415,555.00	1.13
B	采矿业	809,327.56	2.19
C	制造业	19,888,183.69	53.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	669,979.75	1.81
E	建筑业	534,846.00	1.45
F	批发和零售业	483,530.35	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	937,248.00	2.54
H	住宿和餐饮业	30,918.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,356,359.43	3.67
J	金融业	6,898,308.32	18.68
K	房地产业	921,724.39	2.50
L	租赁和商务服务业	633,223.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	294,834.20	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	19,890.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,669.00	0.12
Q	卫生和社会工作	473,919.89	1.28
R	文化、体育和娱乐业	229,714.56	0.62
S	综合	12,072.00	0.03
	合计	34,655,303.14	93.85

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	178,264.11	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,926.52	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	189,190.63	0.51

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	600519	贵州茅台	1,000	1,998,000.00	5.41
2	000858	五粮液	3,200	933,920.00	2.53
3	601318	中国平安	8,758	761,770.84	2.06
4	600036	招商银行	16,690	733,525.50	1.99
5	300750	宁德时代	1,900	667,109.00	1.81
6	600276	恒瑞医药	4,280	477,048.80	1.29
7	601888	中国中免	1,600	451,920.00	1.22
8	603288	海天味业	2,220	445,198.80	1.21
9	002415	海康威视	7,600	368,676.00	1.00
10	601166	兴业银行	16,800	350,616.00	0.95
11	600900	长江电力	17,800	341,048.00	0.92
12	300760	迈瑞医疗	800	340,800.00	0.92
13	002475	立讯精密	5,680	318,761.60	0.86
14	000001	平安银行	15,697	303,579.98	0.82
15	002594	比亚迪	1,500	291,450.00	0.79
16	601012	隆基股份	3,091	284,990.20	0.77
17	002304	洋河股份	1,200	283,188.00	0.77
18	002352	顺丰控股	3,100	273,513.00	0.74
19	000568	泸州老窖	1,200	271,392.00	0.73
20	600809	山西汾酒	700	262,703.00	0.71
21	600030	中信证券	8,653	254,398.20	0.69
22	300015	爱尔眼科	3,368	252,229.52	0.68
23	600031	三一重工	6,900	241,362.00	0.65
24	603259	药明康德	1,760	237,107.20	0.64
25	600000	浦发银行	23,788	230,267.84	0.62
26	002714	牧原股份	2,984	230,066.40	0.62

27	600309	万华化学	2,500	227,600.00	0.62
28	000002	万科A	7,910	227,017.00	0.61
29	601398	工商银行	43,600	217,564.00	0.59
30	600887	伊利股份	4,900	217,413.00	0.59
31	300059	东方财富	6,997	216,907.00	0.59
32	688169	石头科技	200	207,200.00	0.56
33	601601	中国太保	5,100	195,840.00	0.53
34	300122	智飞生物	1,300	192,283.00	0.52
35	601288	农业银行	60,400	189,656.00	0.51
36	000661	长春高新	400	179,564.00	0.49
37	002142	宁波银行	4,846	171,257.64	0.46
38	601668	中国建筑	34,000	168,980.00	0.46
39	600585	海螺水泥	3,200	165,184.00	0.45
40	000725	京东方A	27,400	164,400.00	0.45
41	603501	韦尔股份	700	161,770.00	0.44
42	600104	上汽集团	6,300	153,972.00	0.42
43	600048	保利地产	9,700	153,454.00	0.42
44	600016	民生银行	28,680	149,136.00	0.40
45	600690	海尔智家	5,105	149,117.05	0.40
46	601899	紫金矿业	15,900	147,711.00	0.40
47	601328	交通银行	31,800	142,464.00	0.39
48	600999	招商证券	6,020	140,506.80	0.38
49	600438	通威股份	3,500	134,540.00	0.36
50	600436	片仔癀	500	133,755.00	0.36
51	600346	恒力石化	4,720	132,018.40	0.36
52	300124	汇川技术	1,400	130,620.00	0.35
53	601818	光大银行	32,200	128,478.00	0.35
54	002493	荣盛石化	4,600	127,006.00	0.34
55	300014	亿纬锂能	1,541	125,591.50	0.34
56	601100	恒立液压	1,084	122,492.00	0.33
57	002027	分众传媒	11,900	117,453.00	0.32

58	600588	用友网络	2,624	115,114.88	0.31
59	000538	云南白药	1,000	113,600.00	0.31
60	300999	金龙鱼	1,000	108,320.00	0.29
61	601688	华泰证券	6,000	108,060.00	0.29
62	000895	双汇发展	2,300	107,962.00	0.29
63	300433	蓝思科技	3,500	107,135.00	0.29
64	601211	国泰君安	6,100	106,933.00	0.29
65	600893	航发动力	1,800	106,830.00	0.29
66	300601	康泰生物	600	104,700.00	0.28
67	601766	中国中车	19,700	104,607.00	0.28
68	000063	中兴通讯	3,100	104,315.00	0.28
69	300413	芒果超媒	1,400	101,500.00	0.27
70	600837	海通证券	7,800	100,308.00	0.27
71	002812	恩捷股份	700	99,246.00	0.27
72	601336	新华保险	1,700	98,549.00	0.27
73	600406	国电南瑞	3,700	98,309.00	0.27
74	600703	三安光电	3,600	97,236.00	0.26
75	002241	歌尔股份	2,600	97,032.00	0.26
76	000166	申万宏源	18,200	96,096.00	0.26
77	601919	中远海控	7,800	95,238.00	0.26
78	600570	恒生电子	890	93,361.00	0.25
79	300498	温氏股份	5,120	93,337.60	0.25
80	600050	中国联通	20,900	93,214.00	0.25
81	601066	中信建投	2,200	92,400.00	0.25
82	688981	中芯国际	1,600	92,400.00	0.25
83	002460	赣锋锂业	900	91,080.00	0.25
84	601988	中国银行	28,400	90,312.00	0.24
85	601229	上海银行	11,502	90,175.68	0.24
86	603993	洛阳钼业	14,300	89,375.00	0.24
87	600019	宝钢股份	15,000	89,250.00	0.24
88	601390	中国中铁	16,500	86,955.00	0.24

89	300274	阳光电源	1,200	86,736.00	0.23
90	600196	复星医药	1,600	86,384.00	0.23
91	002311	海大集团	1,300	85,150.00	0.23
92	601628	中国人寿	2,200	84,458.00	0.23
93	600028	中国石化	20,600	83,018.00	0.22
94	600763	通策医疗	300	82,956.00	0.22
95	688008	澜起科技	1,000	82,880.00	0.22
96	601169	北京银行	17,100	82,764.00	0.22
97	688111	金山办公	200	82,200.00	0.22
98	000768	中航西飞	2,232	81,869.76	0.22
99	000596	古井贡酒	300	81,600.00	0.22
100	601088	中国神华	4,400	79,244.00	0.21
101	000625	长安汽车	3,600	78,768.00	0.21
102	000876	新希望	3,500	78,400.00	0.21
103	000776	广发证券	4,800	78,144.00	0.21
104	601006	大秦铁路	12,000	77,520.00	0.21
105	601989	中国重工	18,500	77,515.00	0.21
106	000100	TCL科技	10,900	77,172.00	0.21
107	600660	福耀玻璃	1,600	76,880.00	0.21
108	603799	华友钴业	956	75,810.80	0.21
109	000338	潍柴动力	4,800	75,792.00	0.21
110	002271	东方雨虹	1,946	75,504.80	0.20
111	600741	华域汽车	2,600	74,932.00	0.20
112	300454	深信服	300	74,403.00	0.20
113	002230	科大讯飞	1,800	73,566.00	0.20
114	601186	中国铁建	9,300	73,470.00	0.20
115	601857	中国石油	17,500	72,625.00	0.20
116	002371	北方华创	400	72,296.00	0.20
117	600926	杭州银行	4,840	72,212.80	0.20
118	002050	三花智控	2,880	70,992.00	0.19
119	603899	晨光文具	800	70,848.00	0.19

120	600547	山东黄金	2,988	70,576.56	0.19
121	002179	中航光电	900	70,461.00	0.19
122	001979	招商蛇口	5,301	70,450.29	0.19
123	600760	中航沈飞	900	70,362.00	0.19
124	601901	方正证券	6,700	69,479.00	0.19
125	601877	正泰电器	1,752	68,608.32	0.19
126	601633	长城汽车	1,800	68,058.00	0.18
127	603986	兆易创新	343	67,742.50	0.18
128	002049	紫光国微	500	66,905.00	0.18
129	601138	工业富联	4,861	66,547.09	0.18
130	600919	江苏银行	12,090	66,011.40	0.18
131	601009	南京银行	8,100	65,448.00	0.18
132	600015	华夏银行	10,400	65,000.00	0.18
133	002007	华兰生物	1,510	63,782.40	0.17
134	002129	中环股份	2,500	63,750.00	0.17
135	688012	中微公司	400	63,036.00	0.17
136	601155	新城控股	1,800	62,694.00	0.17
137	601225	陕西煤业	6,700	62,578.00	0.17
138	603160	汇顶科技	400	62,220.00	0.17
139	600009	上海机场	800	60,528.00	0.16
140	002821	凯莱英	200	59,828.00	0.16
141	600600	青岛啤酒	600	59,640.00	0.16
142	601788	光大证券	3,200	59,264.00	0.16
143	300450	先导智能	700	58,793.00	0.16
144	002024	苏宁易购	7,500	57,825.00	0.16
145	002600	领益智造	4,800	57,552.00	0.16
146	002841	视源股份	500	57,515.00	0.16
147	603369	今世缘	1,000	57,380.00	0.16
148	002001	新和成	1,700	57,256.00	0.16
149	300782	卓胜微	100	57,054.00	0.15
150	601360	三六零	3,600	56,556.00	0.15

151	600176	中国巨石	2,820	56,287.20	0.15
152	600958	东方证券	4,800	55,824.00	0.15
153	000786	北新建材	1,392	55,749.60	0.15
154	600584	长电科技	1,300	55,341.00	0.15
155	601933	永辉超市	7,700	55,286.00	0.15
156	002555	三七互娱	1,700	53,091.00	0.14
157	601816	京沪高铁	9,300	52,638.00	0.14
158	002414	高德红外	1,250	52,187.50	0.14
159	300408	三环集团	1,400	52,150.00	0.14
160	601985	中国核电	10,500	51,660.00	0.14
161	000157	中联重科	5,200	51,480.00	0.14
162	603882	金域医学	400	51,248.00	0.14
163	300347	泰格医药	317	51,230.37	0.14
164	603833	欧派家居	380	51,110.00	0.14
165	600183	生益科技	1,800	50,688.00	0.14
166	300677	英科医疗	300	50,445.00	0.14
167	600383	金地集团	3,700	49,950.00	0.14
168	300033	同花顺	400	49,592.00	0.13
169	601799	星宇股份	245	49,122.50	0.13
170	601939	建设银行	7,800	48,984.00	0.13
171	600845	宝信软件	710	48,975.80	0.13
172	600426	华鲁恒升	1,300	48,490.00	0.13
173	000938	紫光股份	2,360	48,262.00	0.13
174	601669	中国电建	12,400	48,112.00	0.13
175	002236	大华股份	2,400	47,736.00	0.13
176	600132	重庆啤酒	400	47,596.00	0.13
177	002916	深南电路	440	47,546.40	0.13
178	300628	亿联网络	650	47,528.00	0.13
179	600886	国投电力	5,500	47,520.00	0.13
180	002624	完美世界	1,600	47,200.00	0.13
181	000799	酒鬼酒	300	46,950.00	0.13

182	601377	兴业证券	5,400	46,872.00	0.13
183	000069	华侨城 A	6,600	46,794.00	0.13
184	002736	国信证券	3,400	46,376.00	0.13
185	688126	沪硅产业	1,400	46,368.00	0.13
186	300142	沃森生物	1,200	46,272.00	0.13
187	002607	中公教育	1,300	45,669.00	0.12
188	000066	中国长城	2,400	45,576.00	0.12
189	603659	璞泰来	400	44,956.00	0.12
190	600029	南方航空	7,500	44,700.00	0.12
191	688002	睿创微纳	400	44,400.00	0.12
192	601878	浙商证券	2,900	44,370.00	0.12
193	601881	中国银河	3,500	43,785.00	0.12
194	300724	捷佳伟创	300	43,680.00	0.12
195	000860	顺鑫农业	600	43,524.00	0.12
196	601658	邮储银行	9,100	43,498.00	0.12
197	002791	坚朗五金	300	43,200.00	0.12
198	002601	龙蟠佰利	1,400	43,078.00	0.12
199	300529	健帆生物	630	42,726.60	0.12
200	603806	福斯特	500	42,700.00	0.12
201	002602	世纪华通	6,000	42,660.00	0.12
202	603444	吉比特	100	42,600.00	0.12
203	603019	中科曙光	1,220	41,760.60	0.11
204	002568	百润股份	400	41,716.00	0.11
205	600161	天坛生物	1,000	41,700.00	0.11
206	002709	天赐材料	400	41,520.00	0.11
207	600340	华夏幸福	3,170	40,988.10	0.11
208	603338	浙江鼎力	400	40,476.00	0.11
209	601111	中国国航	5,400	40,446.00	0.11
210	600061	国投资本	2,900	40,107.00	0.11
211	600872	中炬高新	600	39,990.00	0.11
212	300207	欣旺达	1,300	39,923.00	0.11

213	002202	金风科技	2,800	39,900.00	0.11
214	603939	益丰药房	440	39,683.60	0.11
215	600486	扬农化工	300	39,600.00	0.11
216	601618	中国中冶	14,500	39,585.00	0.11
217	002410	广联达	500	39,370.00	0.11
218	603233	大参林	500	39,175.00	0.11
219	600109	国金证券	2,400	39,048.00	0.11
220	601021	春秋航空	700	38,801.00	0.11
221	000963	华东医药	1,460	38,777.60	0.11
222	603517	绝味食品	500	38,770.00	0.10
223	600521	华海药业	1,142	38,611.02	0.10
224	603345	安井食品	200	38,574.00	0.10
225	300676	华大基因	300	38,568.00	0.10
226	601600	绿地控股	10,600	38,478.00	0.10
227	600606	中国铝业	6,600	38,478.00	0.10
228	300003	乐普医疗	1,400	38,052.00	0.10
229	600111	北方稀土	2,900	37,961.00	0.10
230	002625	光启技术	1,700	37,825.00	0.10
231	000783	长江证券	4,500	37,800.00	0.10
232	000703	恒逸石化	2,930	37,504.00	0.10
233	688396	华润微	600	37,494.00	0.10
234	600079	人福医药	1,100	37,268.00	0.10
235	300595	欧普康视	450	36,864.00	0.10
236	300144	宋城演艺	2,080	36,857.60	0.10
237	601990	南京证券	3,000	36,810.00	0.10
238	601916	浙商银行	9,000	36,720.00	0.10
239	601108	财通证券	2,900	36,685.00	0.10
240	002459	晶澳科技	900	36,648.00	0.10
241	002384	东山精密	1,400	36,400.00	0.10
242	002044	美年健康	3,200	36,256.00	0.10
243	600674	川投能源	3,600	36,180.00	0.10

244	002120	韵达股份	2,300	36,110.00	0.10
245	300285	国瓷材料	800	36,088.00	0.10
246	600143	金发科技	2,100	35,994.00	0.10
247	600795	国电电力	15,900	35,775.00	0.10
248	000547	航天发展	1,300	35,750.00	0.10
249	600298	安琪酵母	700	35,749.00	0.10
250	601727	上海电气	6,600	35,640.00	0.10
251	300699	光威复材	400	35,620.00	0.10
252	603605	珀莱雅	200	35,600.00	0.10
253	600115	东方航空	7,600	35,568.00	0.10
254	002013	中航机电	3,100	35,495.00	0.10
255	600352	浙江龙盛	2,600	35,412.00	0.10
256	603816	顾家家居	500	35,255.00	0.10
257	601966	玲珑轮胎	1,000	35,170.00	0.10
258	300496	中科创达	300	35,100.00	0.10
259	601689	拓普集团	900	34,587.00	0.09
260	603638	艾迪精密	500	34,470.00	0.09
261	603589	口子窖	500	34,450.00	0.09
262	600489	中金黄金	3,900	34,359.00	0.09
263	600018	上港集团	7,500	34,275.00	0.09
264	600316	洪都航空	600	34,122.00	0.09
265	002157	正邦科技	2,000	34,080.00	0.09
266	600362	江西铜业	1,700	33,915.00	0.09
267	002080	中材科技	1,400	33,852.00	0.09
268	000425	徐工机械	6,300	33,831.00	0.09
269	002797	第一创业	3,400	33,830.00	0.09
270	601216	君正集团	6,800	33,660.00	0.09
271	002252	上海莱士	4,500	33,300.00	0.09
272	600779	水井坊	400	33,208.00	0.09
273	600862	中航高科	1,100	33,110.00	0.09
274	601162	天风证券	5,400	32,940.00	0.09

275	002385	大北农	3,400	32,844.00	0.09
276	002508	老板电器	800	32,624.00	0.09
277	002739	万达电影	1,800	32,544.00	0.09
278	600885	宏发股份	600	32,532.00	0.09
279	000977	浪潮信息	1,204	32,363.52	0.09
280	300558	贝达药业	300	32,211.00	0.09
281	600118	中国卫星	1,000	32,180.00	0.09
282	600332	白云山	1,100	32,175.00	0.09
283	600705	中航资本	7,300	31,974.00	0.09
284	000728	国元证券	3,530	31,628.80	0.09
285	601319	中国人保	4,800	31,536.00	0.09
286	600536	中国软件	400	31,504.00	0.09
287	601233	桐昆股份	1,528	31,461.52	0.09
288	300146	汤臣倍健	1,300	31,395.00	0.09
289	600038	中直股份	500	31,355.00	0.08
290	601872	招商轮船	5,500	31,075.00	0.08
291	002032	苏泊尔	398	31,040.02	0.08
292	601555	东吴证券	3,140	30,960.40	0.08
293	601838	成都银行	2,900	30,943.00	0.08
294	600754	锦江酒店	600	30,918.00	0.08
295	601607	上海医药	1,600	30,720.00	0.08
296	300357	我武生物	400	30,680.00	0.08
297	600219	南山铝业	9,700	30,652.00	0.08
298	300308	中际旭创	600	30,516.00	0.08
299	000656	金科股份	4,300	30,487.00	0.08
300	600482	中国动力	1,700	30,464.00	0.08
301	600066	宇通客车	1,800	30,456.00	0.08
302	600089	特变电工	3,000	30,450.00	0.08
303	300037	新宙邦	300	30,420.00	0.08
304	002078	太阳纸业	2,100	30,303.00	0.08
305	603737	三棵树	200	30,300.00	0.08

306	300316	晶盛机电	1,000	30,080.00	0.08
307	002185	华天科技	2,200	29,964.00	0.08
308	300253	卫宁健康	1,710	29,925.00	0.08
309	600233	圆通速递	2,600	29,900.00	0.08
310	600511	国药股份	600	29,586.00	0.08
311	000050	深天马 A	2,000	29,480.00	0.08
312	600739	辽宁成大	1,205	29,305.60	0.08
313	601198	东兴证券	2,200	29,304.00	0.08
314	000800	一汽解放	2,500	29,200.00	0.08
315	600369	西南证券	5,400	29,052.00	0.08
316	603658	安图生物	200	29,036.00	0.08
317	002456	欧菲光	2,200	28,996.00	0.08
318	300251	光线传媒	2,400	28,968.00	0.08
319	002773	康弘药业	600	28,890.00	0.08
320	300136	信维通信	800	28,704.00	0.08
321	002673	西部证券	2,800	28,392.00	0.08
322	002353	杰瑞股份	800	28,000.00	0.08
323	600699	均胜电子	1,100	27,896.00	0.08
324	002156	通富微电	1,100	27,764.00	0.08
325	601456	国联证券	1,300	27,729.00	0.08
326	601800	中国交建	3,800	27,588.00	0.07
327	600460	士兰微	1,100	27,500.00	0.07
328	300223	北京君正	300	27,447.00	0.07
329	000961	中南建设	3,100	27,373.00	0.07
330	002127	南极电商	2,000	27,360.00	0.07
331	002340	格林美	3,900	27,261.00	0.07
332	600998	九州通	1,500	27,240.00	0.07
333	600522	中天科技	2,500	27,100.00	0.07
334	600177	雅戈尔	3,751	26,969.69	0.07
335	688009	中国通号	4,600	26,956.00	0.07
336	600598	北大荒	1,400	26,950.00	0.07

337	600004	白云机场	1,900	26,847.00	0.07
338	300482	万孚生物	300	26,763.00	0.07
339	002299	圣农发展	1,000	26,540.00	0.07
340	600023	浙能电力	7,300	26,499.00	0.07
341	600011	华能国际	5,900	26,432.00	0.07
342	300661	圣邦股份	100	26,380.00	0.07
343	002463	沪电股份	1,400	26,306.00	0.07
344	600085	同仁堂	1,100	26,290.00	0.07
345	002926	华西证券	2,100	26,208.00	0.07
346	000750	国海证券	4,440	26,018.40	0.07
347	002500	山西证券	2,900	25,955.00	0.07
348	002925	盈趣科技	400	25,732.00	0.07
349	002603	以岭药业	1,000	25,500.00	0.07
350	002030	达安基因	740	25,382.00	0.07
351	002507	涪陵榨菜	600	25,380.00	0.07
352	600390	五矿资本	3,600	25,128.00	0.07
353	600529	山东药玻	500	25,075.00	0.07
354	603456	九洲药业	700	25,060.00	0.07
355	600637	东方明珠	2,799	25,023.06	0.07
356	603712	七一二	600	24,990.00	0.07
357	002373	千方科技	1,300	24,856.00	0.07
358	600150	中国船舶	1,400	24,766.00	0.07
359	002558	巨人网络	1,400	24,402.00	0.07
360	600068	葛洲坝	3,700	24,346.00	0.07
361	002372	伟星新材	1,300	24,310.00	0.07
362	600415	小商品城	4,400	24,244.00	0.07
363	002180	纳思达	900	24,057.00	0.07
364	000932	华菱钢铁	5,000	23,900.00	0.06
365	603707	健友股份	680	23,888.40	0.06
366	603883	老百姓	380	23,875.40	0.06
367	603866	桃李面包	400	23,640.00	0.06

368	600372	中航电子	1,200	23,580.00	0.06
369	601117	中国化学	4,000	23,480.00	0.06
370	002422	科伦药业	1,200	23,328.00	0.06
371	300463	迈克生物	500	23,300.00	0.06
372	600988	赤峰黄金	1,300	23,283.00	0.06
373	000739	普洛药业	1,000	23,280.00	0.06
374	601231	环旭电子	1,200	23,208.00	0.06
375	600909	华安证券	2,900	23,200.00	0.06
376	600655	豫园股份	2,600	23,114.00	0.06
377	002511	中顺洁柔	1,100	22,957.00	0.06
378	002429	兆驰股份	3,700	22,940.00	0.06
379	002958	青农商行	4,500	22,905.00	0.06
380	002146	荣盛发展	3,500	22,855.00	0.06
381	000021	深科技	1,200	22,812.00	0.06
382	603156	养元饮品	880	22,739.20	0.06
383	600801	华新水泥	1,100	22,693.00	0.06
384	002294	信立泰	800	22,664.00	0.06
385	600487	亨通光电	1,620	22,663.80	0.06
386	002223	鱼跃医疗	800	22,568.00	0.06
387	002405	四维图新	1,577	22,503.79	0.06
388	601099	太平洋	5,500	22,440.00	0.06
389	600380	健康元	1,608	22,367.28	0.06
390	600895	张江高科	1,300	22,152.00	0.06
391	002690	美亚光电	500	22,140.00	0.06
392	000723	美锦能源	3,300	22,044.00	0.06
393	603858	步长制药	955	22,031.85	0.06
394	600848	上海临港	1,100	22,022.00	0.06
395	600875	东方电气	2,204	21,973.88	0.06
396	600867	通化东宝	1,640	21,943.20	0.06
397	600516	方大炭素	3,100	21,917.00	0.06
398	002939	长城证券	1,700	21,879.00	0.06

399	000630	铜陵有色	8,500	21,845.00	0.06
400	000987	越秀金控	1,500	21,840.00	0.06
401	000998	隆平高科	1,100	21,791.00	0.06
402	002153	石基信息	700	21,763.00	0.06
403	600208	新湖中宝	7,000	21,700.00	0.06
404	600170	上海建工	7,200	21,672.00	0.06
405	600498	烽火通信	900	21,672.00	0.06
406	601077	渝农商行	4,800	21,600.00	0.06
407	002683	宏大爆破	600	21,570.00	0.06
408	002557	洽洽食品	400	21,540.00	0.06
409	000671	阳光城	3,300	21,516.00	0.06
410	002152	广电运通	2,000	21,360.00	0.06
411	002065	东华软件	2,571	21,339.30	0.06
412	002705	新宝股份	500	21,125.00	0.06
413	600642	申能股份	4,000	20,880.00	0.06
414	002081	金螳螂	2,200	20,658.00	0.06
415	000738	航发控制	900	20,637.00	0.06
416	300383	光环新网	1,200	20,604.00	0.06
417	002465	海格通信	1,900	20,577.00	0.06
418	601997	贵阳银行	2,580	20,511.00	0.06
419	002151	北斗星通	400	20,364.00	0.06
420	000513	丽珠集团	500	20,250.00	0.05
421	600188	兖州煤业	2,000	20,140.00	0.05
422	601992	金隅集团	6,777	20,127.69	0.05
423	000999	华润三九	800	19,952.00	0.05
424	300070	碧水源	2,600	19,890.00	0.05
425	000027	深圳能源	3,245	19,762.05	0.05
426	002075	沙钢股份	1,800	19,746.00	0.05
427	600497	驰宏锌锗	4,100	19,680.00	0.05
428	000729	燕京啤酒	2,300	19,596.00	0.05
429	600859	王府井	600	19,548.00	0.05

430	000627	天茂集团	3,992	19,441.04	0.05
431	001914	招商积余	900	19,377.00	0.05
432	000423	东阿阿胶	500	19,355.00	0.05
433	000709	河钢股份	8,600	19,264.00	0.05
434	002242	九阳股份	600	19,224.00	0.05
435	600549	厦门钨业	1,140	19,209.00	0.05
436	300012	华测检测	700	19,159.00	0.05
437	000975	银泰黄金	2,220	19,114.20	0.05
438	002019	亿帆医药	1,000	18,930.00	0.05
439	002212	天融信	900	18,909.00	0.05
440	601179	中国西电	4,100	18,901.00	0.05
441	600271	航天信息	1,500	18,900.00	0.05
442	600153	建发股份	2,300	18,883.00	0.05
443	600297	广汇汽车	6,600	18,876.00	0.05
444	600201	生物股份	900	18,801.00	0.05
445	000983	山西焦煤	3,320	18,724.80	0.05
446	600026	中远海能	2,800	18,704.00	0.05
447	600027	华电国际	5,500	18,700.00	0.05
448	603027	千禾味业	500	18,690.00	0.05
449	000686	东北证券	1,900	18,658.00	0.05
450	000988	华工科技	800	18,552.00	0.05
451	600155	华创阳安	1,400	18,466.00	0.05
452	002563	森马服饰	1,800	18,036.00	0.05
453	000540	中天金融	5,700	17,955.00	0.05
454	300418	昆仑万维	900	17,955.00	0.05
455	300773	拉卡拉	600	17,952.00	0.05
456	600704	物产中大	4,095	17,895.15	0.05
457	600160	巨化股份	2,200	17,842.00	0.05
458	300088	长信科技	2,000	17,780.00	0.05
459	600535	天士力	1,180	17,452.20	0.05
460	002506	协鑫集成	4,100	17,425.00	0.05

461	600315	上海家化	500	17,365.00	0.05
462	002626	金达威	500	17,335.00	0.05
463	600967	内蒙一机	1,400	17,024.00	0.05
464	600008	首创股份	5,990	16,951.70	0.05
465	601118	海南橡胶	3,500	16,870.00	0.05
466	600688	上海石化	4,900	16,856.00	0.05
467	601106	中国一重	5,600	16,744.00	0.05
468	300271	华宇软件	700	16,709.00	0.05
469	002131	利欧股份	5,500	16,665.00	0.05
470	000825	太钢不锈	4,600	16,606.00	0.04
471	600737	中粮糖业	1,700	16,456.00	0.04
472	600879	航天电子	2,200	16,456.00	0.04
473	601128	常熟银行	2,200	16,236.00	0.04
474	000581	威孚高科	700	16,233.00	0.04
475	600977	中国电影	1,300	16,198.00	0.04
476	600583	海油工程	3,600	16,164.00	0.04
477	600667	太极实业	1,700	16,065.00	0.04
478	300024	机器人	1,300	15,990.00	0.04
479	600528	中铁工业	1,800	15,732.00	0.04
480	601699	潞安环能	2,400	15,600.00	0.04
481	002216	三全食品	600	15,570.00	0.04
482	000401	冀东水泥	1,100	15,565.00	0.04
483	600256	广汇能源	5,500	15,565.00	0.04
484	000402	金融街	2,400	15,480.00	0.04
485	601598	中国外运	3,500	15,400.00	0.04
486	300212	易华录	500	15,325.00	0.04
487	603000	人民网	900	15,210.00	0.04
488	000629	攀钢钒钛	7,000	15,190.00	0.04
489	300376	易事特	1,900	15,124.00	0.04
490	600021	上海电力	2,100	14,952.00	0.04
491	600100	同方股份	2,400	14,880.00	0.04

492	000623	吉林敖东	900	14,823.00	0.04
493	600398	海澜之家	2,300	14,766.00	0.04
494	002281	光迅科技	500	14,520.00	0.04
495	600566	济川药业	700	14,161.00	0.04
496	000089	深圳机场	1,700	13,889.00	0.04
497	300017	网宿科技	2,000	13,780.00	0.04
498	002399	海普瑞	800	13,776.00	0.04
499	000028	国药一致	300	13,740.00	0.04
500	601098	中南传媒	1,432	13,646.96	0.04
501	600167	联美控股	1,200	13,620.00	0.04
502	600959	江苏有线	4,060	13,438.60	0.04
503	300296	利亚德	2,100	13,356.00	0.04
504	002387	维信诺	1,100	12,540.00	0.03
505	002010	传化智联	2,600	12,246.00	0.03
506	002468	申通快递	1,200	12,096.00	0.03
507	600673	东阳光	2,400	12,072.00	0.03
508	002439	启明星辰	400	11,684.00	0.03
509	000046	泛海控股	3,500	11,480.00	0.03
510	300026	红日药业	2,400	10,992.00	0.03
511	600185	格力地产	1,700	10,982.00	0.03
512	002572	索菲亚	400	10,360.00	0.03

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	000651	格力电器	2,441	151,195.54	0.41
2	003029	吉大正元	418	10,926.52	0.03

3	003028	振邦智能	256	10,672.64	0.03
4	605155	西大门	280	8,534.40	0.02
5	605277	新亚电子	253	4,288.35	0.01
6	003031	中瓷电子	234	3,573.18	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	601318	中国平安	9,636,472.00	8.82
2	000651	格力电器	4,607,206.89	4.22
3	600519	贵州茅台	3,498,482.00	3.20
4	600276	恒瑞医药	2,330,523.00	2.13
5	601166	兴业银行	2,136,418.00	1.95
6	600887	伊利股份	2,037,835.00	1.86
7	000333	美的集团	2,002,653.00	1.83
8	600030	中信证券	1,915,824.00	1.75
9	300760	迈瑞医疗	1,559,633.00	1.43
10	300750	宁德时代	1,496,048.00	1.37
11	600036	招商银行	1,310,571.00	1.20
12	600837	海通证券	1,309,058.00	1.20
13	000858	五粮液	1,217,901.00	1.11
14	600016	民生银行	1,185,843.23	1.09
15	601328	交通银行	1,183,581.00	1.08
16	600690	海尔智家	1,143,195.00	1.05
17	000002	万科A	1,122,596.40	1.03
18	000661	长春高新	1,014,109.00	0.93
19	300498	温氏股份	972,690.00	0.89
20	002475	立讯精密	885,670.00	0.81

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	601318	中国平安	10,971,134.71	10.04
2	600519	贵州茅台	7,820,271.00	7.16
3	000651	格力电器	4,783,122.00	4.38
4	600276	恒瑞医药	3,524,743.00	3.23
5	600036	招商银行	3,102,790.00	2.84
6	601166	兴业银行	2,846,740.00	2.60
7	000858	五粮液	2,758,024.00	2.52
8	000333	美的集团	2,573,907.00	2.36
9	600030	中信证券	2,454,868.65	2.25
10	600887	伊利股份	2,428,602.00	2.22
11	300750	宁德时代	2,111,382.00	1.93
12	003816	中国广核	1,825,446.92	1.67
13	000002	万科A	1,706,966.00	1.56
14	600016	民生银行	1,678,445.00	1.54
15	601328	交通银行	1,670,054.00	1.53
16	600900	长江电力	1,656,900.38	1.52
17	300760	迈瑞医疗	1,633,235.00	1.49
18	002475	立讯精密	1,632,711.00	1.49
19	600837	海通证券	1,442,898.00	1.32
20	600000	浦发银行	1,337,455.17	1.22

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	124,332,234.08
卖出股票收入（成交）总额	202,215,675.29

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	999,900.00	2.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	999,900.00	2.71

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	019627	20国债01	10,000	999,900.00	2.71

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-364,165.63
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-19,860.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货,均以套期保值为目的。本年度进行了少量的多头套保。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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	8,007.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,137.89
5	应收申购款	33,676.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	63,822.06

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	605277	新亚电子	4,288.35	0.01	新股未上市

§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MSCI中国A股国际指数A	1,085	14,429.46	5,000,450.09	31.94%	10,655,511.18	68.06%

创金合信MSCI中国A股国际指数C	537	17,031.65	5,000,450.00	54.67%	4,145,544.79	45.33%
合计	1,586	15,638.06	10,000,900.09	40.32%	14,801,055.97	59.68%

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MSCI中国A股国际指数A	72,936.19	0.47%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	1,326.56	0.01%
	合计	74,262.75	0.30%

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

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	10,000,900.09	40.32%	10,000,900.09	40.32%	36月
基金管理人高级管理人员	15,134.07	0.06%	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	10,016,034.16	40.38%	10,000,900.09	40.32%	36月

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信MSCI中国A股国际指数A	创金合信MSCI中国A股国际指数C
基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额	55,960,583.31	12,417,879.67
本报告期期初基金份额总额	83,112,702.25	15,926,928.22
本报告期基金总申购份额	6,565,013.18	46,327,845.54
减：本报告期基金总赎回份额	74,021,754.16	53,108,778.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,655,961.27	9,145,994.79

§ 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

自2020年7月27日起，奚胜田先生担任创金合信基金管理有限公司副总经理。

自2020年8月28日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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30,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为3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	
英大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	1,202,414.64	0.37%	389.02	0.37%	-
长江证券	2	217,967,999.06	67.50%	70,417.59	66.88%	-

第一创业证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	8,028,779.23	2.49%	3,396.63	3.23%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	1,091,400.00	0.34%	463.23	0.44%	-
中金财富证券	2	17,957.76	0.01%	7.38	0.01%	-
中泰证券	2	21,346,333.26	6.61%	6,901.04	6.55%	-
中信建投证券	2	73,271,368.57	22.69%	23,714.70	22.52%	-

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
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,302,263.00	58.83%	300,000.00	100.00%	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	901,379.00	40.72%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	10,123.43	0.46%	-	-	-	-	-	-

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关于旗下部分开放式基金增加恒天为代销机构暨参加恒天明泽费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
2	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
3	创金合信MSCI中国A股国际	公司官网、中国证监会基金	2020-01-17

	指数发起式证券投资基金2019年第四季度报告	电子披露网站	
4	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2020年1月）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-18
5	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金（2020年1月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-18
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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-14
7	创金合信基金管理有限公司关于延期披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
8	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-17
9	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年第一季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-21
10	创金合信基金管理有限公司关于直销柜台银行账户信息的提示性公告	公司官网、中国证券报	2020-04-29
11	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2019年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-30
12	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-14
13	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金（2	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15

	020年5月) 招募说明书 (更新)		
14	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要 (2020年5月)	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15
15	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-08
16	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-10
17	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金 (2020年7月) 招募说明书 (更新)	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-10
18	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要 (2020年7月)	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-10
19	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-15
20	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年第二季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-21
21	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-31
22	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年资料概要更新A类份额	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-01

23	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年资料概要更新C类份额	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-01
24	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-10
25	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金（2020年9月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
26	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年资料概要更新A类份额	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
27	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年资料概要更新C类份额	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
28	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-16
29	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金（2020年10月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24
30	创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年第三季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28

§ 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	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

别							
机构	1	20200101 - 20200513	25,675,879.46	0.00	25,675,879.46	0.00	0.00%
	2	20200121 - 20200213, 20200427, 20200514 - 20200618	18,811,947.75	0.00	18,811,947.75	0.00	0.00%
	3	20200603 - 20201231	10,000,900.09	0.00	0.00	10,000,900.09	40.32%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动； (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。</p> <p>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。</p>							

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MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金2020年年度报告原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

13.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇二一年三月三十日

