创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）

2018年第一季度报告

基金管理人:创金合信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年04月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年04月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年03月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信鼎鑫睿选定开混合
场内简称	创金睿选
基金主代码	501035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月07日
报告期末基金份额总额	215,825,032.50份
投资目标	在合理控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济，行业轮动效应与定向增发项目优势的深入研究，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
业绩比较基准	中证定向增发事件指数收益率×75%+中债总指数（全价）收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2018年01月01日－2018年03月31日）
1.本期已实现收益	794,573.56
2.本期利润	-1,673,616.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0078
4.期末基金资产净值	218,105,747.84
5.期末基金份额净值	1.0106

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。

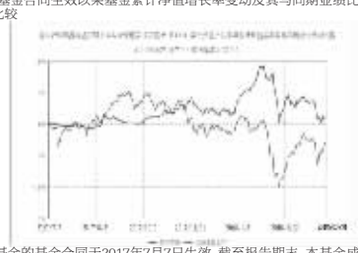
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	-0.76%	0.80%	-2.07%	1.04%	1.31%	-0.24%

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



注:1.本基金的基金合同于2017年7月7日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2.本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王一兵	本基金经理、固定收益部总监	2017-07-10	-	13年	王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业，作为公司出市代表在海南中商期货交易所红马甲。1997年进入股票市场，经历了各种证券市场的大幅涨跌变化，拥有成熟的投资心态和丰富的投资经验。曾历任第一创业证券固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人，熟悉债券市场和固定收益产品的各种投资技巧，尤其精通近两年发展迅速的信用债，对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。
张荣	本基金经理	2017-07-10	-	7年	张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下、把握行业趋势；2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。
曹春林	本基金经理	2017-07-07	-	13年	曹春林先生，中国国籍，厦门大学经济学学士，1998年7月就职于中国银河证券，从事研究工作，2004年3月就职于茂业集团，从事资本运作、证券投资工作，成功操作了A股市场仪有的两例从二级市场收购并控股上市公司的案例，对上市公司的运作转型和并购重组有深刻的理解，擅长从实业的独特视角去看待资本市场，2010年4月加盟第一创业证券，历任资产管理部行业研究员、资产管理部投资压顾问总监。曾获《证券时报》“2013中国最佳财富管理机构评选” 最佳资管产品经理；2014年获《中国基金报》“第一届中国最佳基金经理评选” 三年期权益类投资最佳投资王办。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，曾任资管投资部副总监兼投资经理，现任研究部副总监。

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》的相关决定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共3次，与该基金发生反向交易的基金为公司量化选股策略的基金，同时该产品采用指数化策略进行投资，组合调仓时与量化选股策略基金发生反向，该交易未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在权益投资部分，2018年开年后，旧经济市场出清，供给侧改革持续推进，新兴经济活跃，盈利具备持续转好基础，股票市场表现抢眼。外围市场在美国持续加息的信号下，国债收益率持续走高，美国权益市场开始带领全球权益市场发生较大的调整。同时贸易战升温，全球经济稳定性减弱，权益市场整体波动性加剧。

在债券投资部分，一季度以来，央行货币政策边际放松，货币政策目标更为中性，资金面持续处于较为稳定的状况，修正了市场对于未来资金面的悲观预期；而在融资约束下，过往经济增长的双支柱，房地产投资和基建投资的增速均有所下行，带动经济整体平稳有所走弱，通胀维持低位，基本面对债券市场相对有利；同时金融去杠杆逐步出现成效，金融去杠杆向金融稳杠杆转变，市场对于监管政策的承接能力有所提升。在以上利好的推动下债券市场整体出现了较为明显的上涨行情。1年AAA品种从高点最多下行40bp左右；10年国开债从高点最多下行50bp左右。期限利差和信用利差均有所扩大，呈现牛陡的态势。本基金债券投资部分继续维持短久期的操作策略，控制组合波动，增强产品整体流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鼎鑫睿选定开混合基金份额净值为1.0106元；本报告期内，基金份额净值增长率为-0.76%，同期业绩比较基准收益率为-2.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	107,543,421.84	32.56
	其中:股票	107,543,421.84	32.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	212,023,821.60	64.20
	其中:债券	212,023,821.60	64.20
	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	7,715,777.24	2.34
8	其他资产	2,983,579.93	0.90
9	合计	330,266,600.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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)	占基金资产净值的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,178,699.00	1.46
C	制造业	38,267,121.97	17.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,794,489.00	1.28
E	建筑业	4,536,372.00	2.08
F	批发和零售业	3,632,952.87	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	3,275,373.00	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,611,218.00	1.20
J	金融业	41,547,174.00	19.05
K	房地产业	5,054,792.00	2.32
L	租赁和商务服务业	548,020.00	0.25
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	1,466,760.00	0.67
S	综合	630,450.00	0.29
	合计	107,543,421.84	49.31

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	156,500	10,221,015.00	4.69
2	600519	贵州茅台	7,700	5,263,874.00	2.41
3	600036	招商银行	149,600	4,351,864.00	2.00
4	601166	兴业银行	184,500	3,079,305.00	1.41
5	600887	伊利股份	99,600	2,837,604.00	1.30
6	600016	民生银行	352,800	2,818,872.00	1.29
7	601328	交通银行	413,000	2,552,340.00	1.17
8	600030	中信证券	120,200	2,233,316.00	1.02
9	601288	农业银行	566,800	2,216,188.00	1.02
10	600000	浦发银行	166,900	1,944,385.00	0.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	151,750,500.00	69.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	60,273,321.60	27.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,023,821.60	97.21

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	112328	16曲文01	200,000	19,906,000.00	9.13
2	132009	17中油EB	200,000	19,808,000.00	9.08
3	113011	光大转债	181,700	19,710,816.00	9.04
4	136247	16华控01	200,000	19,656,000.00	9.01
5	112402	16华股01	200,000	19,628,000.00	9.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 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。

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,412.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,962,167.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,983,579.93

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	19,710,816.00	9.04
2	110032	三一转债	9,665,905.60	4.43

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资国债期货。

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	215,825,032.50
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	215,825,032.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比	
机构	1	20180101－20180331	90,007,100.00	0.00	0.00	90,007,100.00	41.70%	

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；

2、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；

3、创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)2018年第1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15楼

9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇一八年四月十九日

创金合信国证A股指数发起式证券投资基金

2018年第一季度报告

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
报告送出日期:2018年04月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年04月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年03月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信国证A股指数	
基金主代码	006414	
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	
报告期末基金份额总额	11,466,076.74份	
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，属处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。	
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	
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	006414	006415
报告期末下属分级基金的份额总额	5,715,929.82份	5,739,146.92份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年01月01日－2018年03月31日)	
	创金合信国证A股指数A	创金合信国证A股指数C
1.本期已实现收益	-59,178.59	-66,029.79
2.本期利润	-182,457.86	-185,731.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0312	-0.0315
4.期末基金资产净值	5,547,623.80	5,565,453.68
5.期末基金份额净值	0.9706	0.9697

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.13%	1.20%	-3.06%	1.16%	-0.07%	0.04%

创金合信国证A股指数C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.22%	1.20%	-3.06%	1.16%	-0.16%	0.04%

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

注:1.本基金的基金合同于2017年12月28日生效，截至报告期末，本基金成立不满一年。

2.按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十三部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期末基金处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	本基金经理	2017-12-28	-	10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，负责股票现货、股指期货及其他金融衍生产品的研究开发和交易管理等工作。2016年3月加入创金合信基金管理有限公司，负责证券指数化投资策略及产品的研究分析工作，现任指数策略投资研究部副总监、基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年一季度，国外市场中美国经济继续复苏，同时货币政策继续从紧，加息25个基点，美股市创历史新高后出现较大幅度回调。国内方面，宏观经济形势稳健向好，在去杠杆防风险的政策导向下，货币政策中性偏紧，市场监管趋严，实体经济和金融体系的弹性与韧性进一步增强。但美国发动贸易战，短期带来了额外的不确定性。市场方面，受美国加息、美股回调、贸易争端等因素影响，本报告期内中国A股市场走出了冲高回调、反弹受阻的行情。

4.5 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0.9706元；本报告期内，基金份额净值增长率为-3.13%，同期业绩比较基准收益率为-3.06%；截至报告期末创金合信国证A股指数C基金份额净值为0.9697元；本报告期内，基金份额净值增长率为-3.22%，同期业绩比较基准收益率为-3.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,535,107.00	93.74
	其中:股票	10,535,107.00	93.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	699,545.04	6.22
8	其他资产	3,810.87	0.03
9	合计	11,238,462.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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)	占基金资产净值的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	142,319.00	1.28
B	采矿业	346,619.00	3.12
C	制造业	5,329,010.00	47.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,911.00	2.24
E	建筑业	290,665.00	2.62
F	批发和零售业	386,639.00	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	323,818.00	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	660,111.00	5.94
J	金融业	1,770,387.00	15.93
K	房地产业	503,848.00	4.53
L	租赁和商务服务业	127,255.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	19,362.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	100,438.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	26,101.00	0.23
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	188,979.00	1.70
S	综合	26,101.00	0.23
	合计	10,535,107.00	94.80

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	5,100	333,081.00	3.00
2	600519	贵州茅台	200	136,724.00	1.23
3	000333	美的集团	2,300	125,419.00	1.13
4	601166	兴业银行	7,500	125,175.00	1.13
5	000651	格力电器	2,300	107,870.00	0.97
6	600887	伊利股份	3,300	94,017.00	0.85
7	601288	农业银行	21,400	83,674.00	0.75
8	601328	交通银行	13,400	82,812.00	0.75
9	600276	恒瑞医药	900	78,309.00	0.70
10	600030	中信证券	4,200	78,036.00	0.70

5.3.2积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 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。

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2017年7月26日，珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”或“格力电器”，股票代码:000651）收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》，认定徐自发作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，并对其采取出具警示函的监管措施。2017年10月19日，公司公告，获悉公司董事徐自发先生于2017年10月18日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，该通知书内容为“因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你立案调查，请予以配合。”

本基金投研认为，上述违规行为主要系公司董事徐自发所为，行政处罚和立案调查对象也是其本人。公司对此次董事违规行为的调查做出了迅速反应、积极配合并严格履行信披义务，将此次违规买卖所得收益全部收归公司所有，董事徐自发也于2017年10月26日辞职，不在公司担任任何职务，并承诺调查期间和做出调查结论后6个月内、辞职后6个月内不减持所持股份。此次事件无关公司经营活动和基本面变化，本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对该公司进行了投资。

2017年5月，中信证券股份有限公司(下称“中信证券”)收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号)，认定公司违规向司度提供融资融券服务，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31号）第十一条，并对中信证券采取责令改正、给予警告、没收违法所得的处罚。

本基金投研人员分析认为，在受到处罚后，中信券改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。相关处罚对公司发行的相关债券信用风险无实质影响。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中信证券相关债券进行了投资。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,249.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	151.78
5	应收申购款	409.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,810.87

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.5.1 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。

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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

§6 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
报告期期初基金份额总额	5,944,930.98	5,938,242.77
报告期期间基金总申购份额	222,287.53	181,390.60
减:报告期期间基金总赎回份额	451,288.69	380,486.45
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	5,715,929.82	5,739,146.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,700.14	5,000,700.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,700.14	5,000,700.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	87.49	87.13

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§8 报告期末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	87.31	10,001,400.14	87.31	36月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,400.14	87.31	10,001,400.14	87.31	36月

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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