(上接B351版)

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司净资产预期及市净率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的净资产预期及市净率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年10月10日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年10月10日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	712,549.75	196,937.61
结算备付金	3,157.89	1,363.64
存出保证金	395.08	35,428.67
交易性金融资产	1,005,578.64	3,054,444.70
其中：股票投资	704,378.64	913,710.00
基金投资	–	–
债券投资	301,200.00	2,140,734.70
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	1,400,000.00
应收证券清算款	–	3,068.49
应收利息	7,278.98	13,134.96
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,728,960.34	4,704,378.07
负债和所有者权益	本期末 2018年10月10日	上年度末 2017年12月31日
负 债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	–	107.09
应付管理人报酬	282.40	2,361.94
应付托管费	94.16	787.31
应付销售服务费	16.97	53.67
应付交易费用	–	1,597.33
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	15,505.35	108,986.15
负债合计	15,898.88	113,893.49
所有者权益：		
实收基金	1,575,898.38	4,262,821.83
未分配利润	137,163.08	327,662.75
所有者权益合计	1,713,061.46	4,590,484.58
负债和所有者权益总计	1,728,960.34	4,704,378.07

注：1、报告截止日2018年10月10日，基金份额总额1,575,898.38份，其中下属A类基金份额1,297,530.56份，C类基金份额278,367.82份。下属A类基金份额净值1.085元，C类基金份额净值1.096元。

2、本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10日。

7.2 利润表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年10月10日

单位：人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年10月10日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	-117,256.30	17,245,957.90
1.利息收入	27,091.48	14,567,012.93
其中：存款利息收入	4,132.72	118,455.63
债券利息收入	9,500.64	13,803,445.85
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	13,458.12	645,111.45
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	-71,796.32	-6,886,230.14
其中：股票投资收益	-4,500.00	7,389,113.40
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-67,296.32	-15,597,564.94
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	1,322,221.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-74,755.96	9,515,524.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,204.50	49,650.40
减：二、费用	33,778.22	5,155,088.80
1. 管理人报酬	12,791.73	1,956,848.18
2. 托管费	4,264.01	652,282.74
3. 销售服务费	442.56	2,386.64
4. 交易费用	766.17	579,293.40
5. 利息支出	–	1,830,391.69
其中：卖出回购金融资产支出	–	1,830,391.69
6. 税金及附加	8.18	–
7. 其他费用	15,505.57	133,886.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-151,034.52	12,090,869.10
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-151,034.52	12,090,869.10

注：本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年10月10日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年10月10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)	4,262,821.83	327,662.75	4,590,484.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-151,034.52	-151,034.52
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）	-2,686,923.45	-39,465.15	-2,726,388.60
其中：1.基金申购款	651,126.38	44,060.60	695,186.98
2.基金赎回款	-3,338,049.83	-83,525.75	-3,421,575.58
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）	1,575,898.38	137,163.08	1,713,061.46
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	800,107,977.84	-6,090,742.02	794,017,235.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	12,090,869.10	12,090,869.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-795,845,156.01	-5,672,464.33	-801,517,620.34
其中：1.基金申购款	17,439,030.02	1,462,918.04	18,901,948.06
2.基金赎回款	-813,284,186.03	-7,135,382.37	-820,419,568.40
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）	4,262,821.83	327,662.75	4,590,484.58

注：本基金于2018年10月11日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，2018年度实际报告期间为2018年1月1日至2018年10月10日。

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	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]1933号《关于准予创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]1424号《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《创金合信鑫价值灵活配置混合型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800,052,876.11元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1129号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为800,108,876.94份基金份额，其中认购资金利息折合56,000.83份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称"中国邮政储蓄银行")。

根据《创金合信鑫价值灵活配置混合型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。

根据本基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2018年9月27日发布了《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据《关于创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国邮政储蓄银行协商一致，本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司将《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》分别修订为《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》，并已经中国证监会变更注册。《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金基金合同》、《创金合信金融地产精选股票型证券投资基金托管协议》自2018年10月11日起生效，《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×30%＋一年期人民币定期存款利率(税后)×70%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号（年度报告和半年度报告）》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信鑫价值灵活配置混合型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。

经中国证监会批准，本基金基金管理人创金合信基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为创金合信金融地产精选股票型证券投资基金，存续期限不定，因此本基金财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年10月10日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年10月10日(基金合同失效前日）的财务状况以及2018年1月1日至2018年10月10日（基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本基金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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.7.2 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人
第一创业证券股份有限公司(“第一创业证券”)	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期（转型后首日） 2018年01月01日至2018年10月10日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	580,500.00	100.00%	403,635,812.71	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年10月10日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	债券买卖成交金额	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	2,111,666.34	100.00%	68,160,064.10	100.00%

7.4.8.1.4 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年10月10日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	债券回购成交金额	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	67,700,000.00	100.00%	291,600,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期（转型后首日） 2018年01月01日至2018年10月10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	424.52	100.00%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	294,262.13	100.00%	1,597.33	100.00%

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年10月10日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,791.73	1,956,848.18
其中：支付销售机构的客户维护费	1,227.21	3,804.22

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年10月10日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,264.01	652,282.74

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年10月10日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	0.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
创金合信直销	1.94
合计	1.94

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年10月10日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	712,549.75	3,450.82	196,937.61	110,968.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年10月10日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	10.64	–	–	66,201	991,800.00	704,378.64	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年10月10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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年10月10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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年10月10日(基金合同失效前日)，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二层次的余额为301,200.00元，属于第三层次的余额为704,378.64元，无属于第一层次的余额(2017年12月31日：第一层次1,296,572.50元，第二层次1,757,872.20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

上述第三层次资产变动如下：本期交易性金融资产权益工具投资转入第三层级的金额为704,378.64元，截止2018年10月10日(基金合同失效前日)剩余金额为704,378.64元。2018年10月10日(基金合同失效前日)仍持有的资产计入2018年1月1日至2018年10月10日(基金合同失效前日)止期间损益的未实现利得或损失的变动--公允价值变动损益的金额为-209,331.36元。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

由于上述股票估值相关的公司净资产预期及市净率是不可观察输入值，故分类为第三层级。如果相关证券的净资产预期及市净率变动，将导致公允价值的正相关变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年10月10日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告(转型后)

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	4,798,016.07	71.16
	其中：股票	4,798,016.07	71.16
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	306,244.80	4.54
	其中：债券	306,244.80	4.54
	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	1,621,990.12	24.06
8	其他各项资产	16,447.28	0.24
9	合计	6,742,698.27	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	203,237.07	3.22
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	369,050.00	5.84
J	金融业	3,165,831.00	50.08
K	房地产业	1,059,898.00	16.77
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	4,798,016.07	75.90

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	9,300	521,730.00	8.25
2	000002	万 科A	21,900	521,658.00	8.25
3	600036	招商银行	18,500	466,200.00	7.37
4	300059	东方财富	30,500	369,050.00	5.84
5	600340	华夏幸福	14,200	361,390.00	5.72
6	000001	平安银行	36,900	346,122.00	5.48
7	601688	华泰证券	21,300	345,060.00	5.46
8	600030	中信证券	19,800	316,998.00	5.01
9	601398	工商银行	59,900	316,871.00	5.01
10	601288	农业银行	86,900	312,840.00	4.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.cjhxfund.com 网站的年度报告正文。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	1,260,115.00	19.93
2	600030	中信证券	919,426.00	14.54
3	601336	新华保险	902,381.00	14.27
4	000002	万 科A	838,949.00	13.27
5	601318	中国平安	776,023.00	12.28
6	600048	保利地产	736,655.00	11.65
7	600036	招商银行	669,134.00	10.59
8	601688	华泰证券	615,134.00	9.73
9	300059	东方财富	594,309.00	9.40
10	601155	新城控股	553,791.00	8.76
11	600340	华夏幸福	538,462.00	8.52
12	601229	上海银行	521,900.00	8.26
13	002142	宁波银行	519,057.00	8.21
14	000776	广发证券	412,496.00	6.53
15	000001	平安银行	384,258.00	6.08
16	000961	中南建设	383,867.00	6.07
17	300750	宁德时代	342,925.00	5.42
18	601128	常熟银行	323,800.00	5.12
19	601288	农业银行	311,600.00	4.93
20	600837	海通证券	310,403.00	4.91
21	000671	阳 光 城	190,164.00	3.01
22	600622	光大嘉宝	185,921.60	2.94
23	600643	爱建集团	184,986.00	2.93
24	300073	当升科技	137,232.00	2.17

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	928,494.00	14.69
2	600030	中信证券	585,987.00	9.27
3	601336	新华保险	584,168.00	9.24
4	600048	保利地产	551,143.00	8.72
5	601155	新城控股	545,162.46	8.62
6	002142	宁波银行	516,744.00	8.17
7	601229	上海银行	496,995.00	7.86
8	000776	广发证券	410,388.00	6.49
9	000961	中南建设	362,986.00	5.74
10	300750	宁德时代	341,836.00	5.41
11	000002	万 科A	323,135.00	5.11
12	600837	海通证券	320,739.00	5.07
13	601688	华泰证券	252,975.00	4.00
14	300059	东方财富	219,816.00	3.48
15	601128	常熟银行	200,330.00	3.17
16	600340	华夏幸福	194,356.00	3.07
17	600643	爱建集团	187,200.00	2.96
18	600622	光大嘉宝	186,487.00	2.95
19	000671	阳 光 城	181,578.00	2.87
20	601318	中国平安	170,665.00	2.70
21	300073	当升科技	142,925.45	2.26
22	601066	中信建投	141,376.00	2.24

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	12,886,168.60
卖出股票收入（成交）总额	7,999,307.91

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	306,244.80	4.84
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	306,244.80	4.84

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	019585	18国债03	3,060	306,244.80	4.84

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，未出现基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、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	5,679.81
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	9,918.45
5	应收申购款	849.02
6	其他应收款	–
7