创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年08月27日

§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。本半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2019年08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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	71,025,700.37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	55,545,025.71份	15,480,674.66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	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95555
传真		0755-25832571	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30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
本期已实现收益	922,721.63	245,845.48
本期利润	13,677,596.15	3,890,114.24
加权平均基金份额本期利润	0.2318	0.2283
本期基金份额净值增长率	26.83%	26.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0199	-0.0230
期末基金资产净值	55,583,075.22	15,439,480.24
期末基金份额净值	1.0007	0.9973

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 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

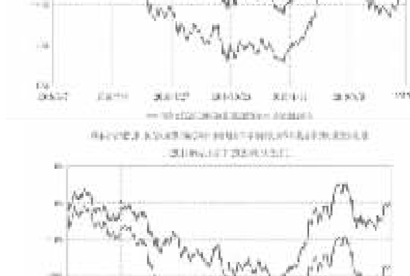
创金合信MSCI中国A股国际指数A

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
过去一个月	5.29%	1.10%	4.82%	1.26%	0.47%	-0.16%
过去三个月	-0.26%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.95%	-0.15%
过去六个月	26.83%	1.44%	23.75%	1.55%	3.08%	-0.11%
过去一年	10.62%	1.43%	3.26%	1.56%	7.36%	-0.13%
自基金合同生效起至今	0.07%	1.33%	-17.43%	1.47%	17.50%	-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
过去一个月	5.27%	1.10%	4.82%	1.26%	0.45%	-0.16%
过去三个月	-0.32%	1.43%	-4.21%	1.58%	3.89%	-0.15%
过去六个月	26.67%	1.44%	23.75%	1.55%	2.92%	-0.11%
过去一年	10.33%	1.43%	3.26%	1.56%	7.07%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-0.27%	1.33%	-17.43%	1.47%	17.16%	-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



注:本基金的合同生效日为2018年2月7日,本基金在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。

截至2019年6月30日,本公司共管理40只公募基金,其中混合型产品8只、指数型产品8只、债券型产品14只、股票型产品9只、货币型产品1只;管理的公募基金规模约155.17亿元。

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	-	11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,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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为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55%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。

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1.0007元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为26.83%,同期业绩比较基准收益率为23.75%;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0.9973元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为26.67%,同期业绩比较基准收益率为23.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期中美贸易谈判重启,摩擦有所缓和,但中美合作有限、竞争加剧的态势将长期存在。短期给出口部门和企业带来下行压力,但长期给国内经济转型升级带来动力;科创板加速落地,带动部分基础性制度革新,利好资本市场长远发展;经过二季度回调,A股整体估值处于中低位水平,具备长期投资价值。此外,MSCI按既定计划进一步提升国际指数中的A股权重,这有助于引入更多境外资金进入A股市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金,不适用本项说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:创金合信MSCI中国A股国际指数发起式证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末2019年06月30日	上年度末2018年12月31日
资产:		
银行存款	1,741,877.57	1,865,175.94
结算备付金	423,359.45	163,034.63
存出保证金	120,858.99	95,516.98
交易性金融资产	68,729,263.27	63,147,040.42
其中:股票投资	65,727,463.27	60,133,840.42
基金投资	-	-
债券投资	3,001,800.00	3,013,200.00
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	-	-
应收证券清算款	76,129.03	-
应收利息	75,922.84	84,355.38
应收股利	-	-
应收申购款	159,930.87	34,470.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	71,327,342.02	65,389,593.60
负债和所有者权益	本期末2019年06月30日	上年度末2018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	181,451.52	241,004.88
应付管理人报酬	28,109.35	28,456.64
应付托管费	5,621.89	5,691.31
应付销售服务费	2,511.00	2,565.16
应付交易费用	15,598.10	2,515.35
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	71,494.70	201,951.22
负债合计	304,786.56	482,184.56
所有者权益:		
实收基金	71,025,700.37	82,306,992.26
未分配利润	-3,144.91	-17,399,583.22
所有者权益合计	71,022,555.46	64,907,409.04
负债和所有者权益总计	71,327,342.02	65,389,593.60

注:1.报告截止日2019年6月30日,基金份额总额71,025,700.37份,其中下属A类基金份额55,545,025.71份,C类基金份额15,480,674.66份。下属A类基金份额净值1.0007元,C类基金份额净值0.9973元。

2.本基金合同生效日为2018年2月7日,上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.2 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:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日
一、收入	17,921,644.36	-8,998,994.08
1.利息收入	57,791.40	48,279.95
其中:存款利息收入	8,096.62	30,156.66
债券利息收入	49,694.78	18,123.29
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,443,737.55	710,548.00
其中:股票投资收益	588,740.92	-165,876.58
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,095.80	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	162,873.79	-
股利收益	700,218.64	876,424.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	16,399,143.28	-9,790,995.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	20,972.13	33,173.63
减:二、费用	353,933.97	385,602.53
1. 管理人报酬	176,301.31	163,601.72
2. 托管费	35,260.30	32,720.33
3. 销售服务费	15,772.03	11,949.98
4. 交易费用	46,153.54	79,095.54
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	586.34	-
7. 其他费用	79,860.45	98,234.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	17,567,710.39	-9,384,596.61
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	17,567,710.39	-9,384,596.61

注:本基金合同生效日为2018年2月7日,上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

6.3 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:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	17,567,710.39	17,567,710.39
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)	-11,281,291.89	-171,272.08	-11,452,563.97
其中:1.基金申购款	11,997,933.57	-472,673.49	11,525,260.08
2.基金赎回款	-23,279,225.46	301,401.41	-22,977,824.05
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)	71,025,700.37	-3,144.91	71,022,555.46
项目	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	68,378,462.98	-	68,378,462.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,384,596.61	-9,384,596.61
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)	27,452,583.46	229,412.31	27,681,995.77
其中:1.基金申购款	37,033,930.70	274.10	37,034,204.80
2.基金赎回款	-9,581,347.24	229,138.21	-9,352,209.03
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)	95,831,046.44	-9,155,184.30	86,675,862.14

注:本基金合同生效日为2018年2月7日,上年度可比期间为2018年2月7日至2018年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信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)。本基金的业绩比较基准为: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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

经创金合信基金管理有限公司(以下简称"本公司"或"公司")股东会决议通过,并经中国证券监督管理委员会(证监许可〔2018〕2082号)核准,本公司进行增资扩股。公司注册资本由17,000万元增加至23,300万元,增融注册资本已由新增股东深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙)、深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙)、深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙)、深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙)、深圳市金合同投资合伙企业(有限合伙)、深圳市金合荣投资合伙企业(有限合伙)认购并已实缴。本公司《公司章程》的有关条款已根据本次增资情况进行了相应修改。上述事项的工商变更登记手续现已于2019年4月29日办理完毕。

6.4.7.2 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
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司("第一创业证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	30,078,187.11	99.05%	88,882,277.34	92.01%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	6,007,791.97	100.00%	3,010,194.40	75.04%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2019年01月01日至2019年06月30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	21,750.67	99.56%	15,598.10	100.00%
关联方名称	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30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	64,399.83	95.16%	5,270.52	61.68%

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,301.31	163,601.72
其中:支付销售机构的客户维护费	83,096.54	72,009.67

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×0.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,260.30	32,720.33

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×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.3 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2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信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	4,235.80	4,235.80
第一创业证券	0.00	69.13	69.13
创金合信直销	0.00	4,643.20	4,643.20
合计	0.00	8,948.13	8,948.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信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
创金合信直销	0.00	3,840.56	3,840.56
第一创业证券	0.00	0.65	0.65
招商银行	0.00	2,626.34	2,626.34
合计	0.00	6,467.55	6,467.55

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×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

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

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

创金合信MSCI中国A股国际指数A

份额单位:份

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日
基金合同生效日(2018年02月07日)持有的基金份额	0.00	5,000,450.09
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,450.09	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.00%	6.44%

创金合信MSCI中国A股国际指数C

份额单位:份

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日
基金合同生效日(2018年02月07日)持有的基金份额	0.00	5,000,450.00
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	5,000,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.30%	27.42%

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间2018年02月07日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,741,877.57	5,600.35	1,306,591.56	28,264.82

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业存款利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

于2019年6月30日,本基金持有53,600.00股招商银行A股普通股,成本总额为人民币1,546,170.21元,估值总额为1,928,528.00元,占基金资产净值比例为2.72%;本基金持有9,000.00股第一创业A股普通股,成本总额为人民币48,577.00元,估值总额为57,060.00元。

6.4.9 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.10 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2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为65,693,593.33元,属于第二层次的余额为3,035,669.94元,无属于第三层次的余额。(2018年12月31日:第一层次59,592,255.42元,第二层次3,554,785.00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2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)其他

除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,727,463.27	92.15
	其中:股票	65,727,463.27	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,001,800.00	4.21
	其中:债券	3,001,800.00	4.21
	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	2,165,237.02	3.04
8	其他各项资产	432,841.73	0.61
9	合计	71,327,342.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	875,817.60	1.23
B	采矿业	2,360,981.60	3.32
C	制造业	28,524,922.01	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,840,683.00	2.59
E	建筑业	1,674,629.00	2.36
F	批发和零售业	1,427,335.60	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,070,773.20	2.92
H	住宿和餐饮业	79,446.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,985,258.35	4.20
J	金融业	18,384,550.20	25.89
K	房地产业	3,281,738.00	4.62
L	租赁和商务服务业	844,255.40	1.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	105,543.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	448,936.70	0.63
R	文化、体育和娱乐业	412,450.00	0.58
S	综合	178,509.00	0.25
	合计	65,495,828.66	92.22

7.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

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	45,848.25	0.06
C	制造业	118,384.74	0.17
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	33,531.68	0.05
J	金融业	33,869.94	0.05
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	231,634.61	0.33

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	3,300	3,247,200.00	4.57
2	601318	中国平安	28,200	2,498,802.00	3.52
3	600036	招商银行	53,600	1,928,528.00	2.72
4	000858	五粮液	10,100	1,191,295.00	1.68
5	601166	兴业银行	53,900	985,831.00	1.39
6	600000	浦发银行	76,200	890,016.00	1.25
7	601398	工商银行	139,900	824,011.00	1.16
8	600276	恒瑞医药	11,560	762,960.00	1.07
9	000002	万科A	25,300	703,593.00	0.99
10	601288	农业银行	193,200	695,520.00	0.98

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网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300782	卓胜微	471	51,301.32	0.07
2	600968	海油发展	12,915	45,848.25	0.06
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.05
4	601698	中国卫通	8,554	33,531.68	0.05
5	300594	朗进科技	631	27,833.41	0.04

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网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	526,632.00	0.81
2	600989	宝丰能源	351,604.72	0.54
3	600519	贵州茅台	251,512.00	0.39
4	600010	包钢股份	231,284.00	0.36
5	300015	爱尔眼科	228,998.10	0.35
6	300059	东方财富	219,377.00	0.34
7	600703	三安光电	192,532.00	0.30
8	601600	中国铝业	159,704.00	0.25
9	300760	迈瑞医疗	158,738.00	0.24
10	600061	国投资本	153,879.00	0.24
11	600518	ST康美	153,860.00	0.24
12	300122	智飞生物	143,223.00	0.22
13	300750	宁德时代	133,701.00	0.21
14	300033	同花顺	124,104.00	0.19
15	000333	美的集团	123,204.00	0.19
16	601318	中国平安	120,605.00	0.19
17	002157	正邦科技	117,310.00	0.18
18	300003	乐普医疗	110,433.00	0.17
19	300142	沃森生物	99,135.00	0.15
20	601108	财通证券	98,190.00	0.15

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	926,338.16	1.43
2	000333	美的集团	654,584.00	1.01
3	601318	中国平安	646,358.00	1.00
4	600036	招商银行	529,357.00	0.82
5	600989	宝丰能源	369,826.44	0.57
6	601166	兴业银行	288,768.00	0.44
7	000858	五粮液	280,056.00	0.43
8	601988	中国银行	277,879.00	0.43
9	600000	浦发银行	250,825.00	0.39
10	600010	包钢股份	233,757.00	0.36
11	601398	工商银行	231,621.00	0.36
12	002415	海康威视	220,655.00	0.34
13	000002	万科A	216,167.00	0.33
14	600518	ST康美	214,439.00	0.33
15	600276	恒瑞医药	213,806.00	0.33
16	601288	农业银行	209,108.00	0.32
17	601668	中国建筑	189,901.00	0.29
18	600900	长江电力	184,483.00	0.28
19	601328	交通银行	183,229.00	0.28
20	600030	中信证券	171,439.00	0.26

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	10,226,684.59
卖出股票收入(成交)总额	21,563,762.11

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,001,800.00	4.23
	其中:政策性金融债	3,001,800.00	4.23
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	3,001,800.00	4.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	30,000	3,001,800.00	4.23

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1909	IF1909	1	1,137,540.00	20,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)				20,880.00	
股指期货投资本期收益(元)				162,873.79	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				67,680.00	

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内持有少量股指期货合约,主要是为了进行多头套保,应对大额申赎和便利流动性管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2018年7月13日,宜宾五粮液股份有限公司(下称"五粮液",股票代码:000858)从四川省纪委、监察委网站获悉宜宾市国有资产经营有限公司董事长张辉(其现任五粮液第五届董事会董事)正接受纪律审查和监察调查。张辉系宜宾市国资公司委派兼任五粮液董事。另2018年8月24日,五粮液从四川省纪委、监察委网站获悉五粮液监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法,目前正接受纪律审查和监察调查。余铭书于2012年7月从宜宾市国有资产经营有限公司调入本公司任职。

本基金投研人员分析认为,上述事项不对五粮液生产经营和长远发展产生影响,五粮液将关注后续进展情况,并按有关规定及时履行相关程序和信息披露义务。五粮液作为白酒行业龙头之一,业绩稳健,维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对五粮液进行了投资。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120,858.99
2	应收证券清算款	76,129.03
3	应收股利	-
4	应收利息	75,922.84
5	应收申购款	159,930.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	432,841.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.05	新发流通受限

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
创金合信MSCI中国A股国际指数A	1,748	31,776.33	5,000,450.09	9.00%	50,544,575.62	91.00%
创金合信MSCI中国A股国际指数C	614	25,212.83	5,000,450.00	32.30%	10,480,224.66	67.70%
合计	2,308	30,773.70	10,000,900.09	14.08%	61,024,800.28	85.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信MSCI中国A股国际指数A	140,662.48	0.25%
	创金合信MSCI中国A股国际指数C	122,819.72	0.79%
	合计	263,482.20	0.37%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	14.08%	10,000,900.09	14.08%	36月
基金管理人高级管理人员	14,678.78	0.02%	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	10,015,578.87	14.10%	10,000,900.09	14.08%	36月

§9 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	63,735,597.38	18,571,394.88
本报告期基金总申购份额	8,715,194.44	3,282,739.13
减:本报告期基金总赎回份额	16,905,766.11	6,373,459.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,545,025.71	15,480,674.66

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2019年6月12日起,张雪松先生不再担任创金合信基金管理有限公司副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	30,078,187.11	99.05%	21,750.67	99.56%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	288,068.00	0.95%	95.42	0.44%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

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。

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	6,007,791.97	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十七日