创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019年06月30日
基金管理人:创金合信基金管理有限公司
基金托管人:中国工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。

基金托管人中国工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	创金合信优选回报混合
基金主代码	005076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年09月27日
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
报告期末基金份额总额	173,215,091.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,追求基金资产净值的长期稳健增长。
投资策略	在大类资产配置上,本基金将通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策的分析和预测,判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势,结合对资金供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析,评估各类别资产的风险收益特征,并加以分析比较,采用定性和定量相结合的方法,形成对不同类别资产表现的预测,确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等资产类别间的配置比例。 本基金将密切关注市场整体风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势,在严格控制基金风险敞口的前提下,根据敞口大小和资产风险水平动态调整各大类资产之间的配置比例,力争提高基金收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*30%+中债综合指数收益率*70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	郭明
	联系电话	0755-23838908	010-66105799
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95588
传真		0755-25832571	010-66105798

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)
本期已实现收益	7,716,246.69
本期利润	44,366,867.58
加权平均基金份额本期利润	0.1585
本期基金份额净值增长率	8.24%
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	-0.0245
期末基金资产净值	168,968,006.74
期末基金份额净值	0.9755

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。

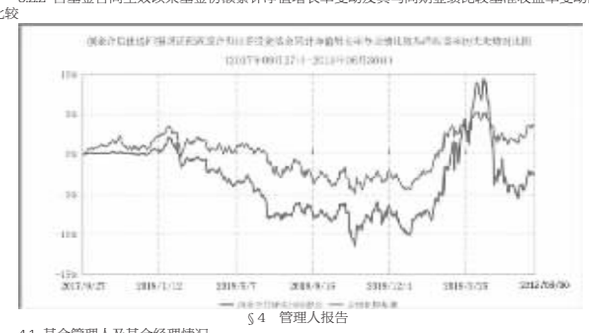
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	1.46%	0.58%	1.82%	0.34%	-0.36%	0.24%
过去三个月	-5.44%	1.20%	-0.38%	0.44%	-5.06%	0.76%
过去六个月	8.24%	1.12%	7.97%	0.45%	0.27%	0.67%
过去一年	5.28%	0.90%	5.27%	0.45%	0.01%	0.45%
自基金合同生效起至今	-2.45%	0.71%	3.58%	0.39%	-6.03%	0.32%

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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复,2014年7月9日正式注册设立,注册地为深圳市。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司,出资比例51.0729%;深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙),出资比例21.8884%;深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合同投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合荣投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%。

公司始终坚持"客户利益至上",致力于为客户实现长期稳定的投资回报,做客户投资理财的亲密伙伴。

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

@

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

2019年上半年市场快速普涨后振荡回调,中证2000、创业板指、沪深300、上证50等代表性小中大市值风格涨幅区间19%-28%,但行业涨幅结构性分化巨大。上半年白酒和消费指数涨幅最大分别达到77%和57%,保险、证券指数涨幅也分别达到46%和38%,而周期类板块涨幅滞后,如钢铁、煤炭板块涨幅仅9%和17%。基金组合上半年维持了低市净率、低市值、国企股风格配置,组合弹性与市场平均水平基本一致,同时对超额收益较大的个股进行了配置调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信优选回报混合基金份额净值为0.9755元,本报告期内,基金份额净值增长率为8.24%,同期业绩比较基准收益率为7.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在国内三年去杠杆和贸易争端持续两大背景下,未来市场难有趋势性机会,局部结构性轮动概率较大。未来组合策略上采取大/小市值、高/低贝塔结合的哑铃型策略,个股方面坚持"三低"选股策略,重点关注国家关于国企尽快降杠杆政策导向下国企改革个性化基本面反转机会。同时采取卖涨买跌的超额收益轮动策略,适度减仓涨幅大的个股置换为持股中涨幅较小并接近市场热点行业或风格的超跌个股,提升组合弹性和控制回撤风险。

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

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,若基金在每季度最后一个交易日日终,基金份额净值高于1.100元(含)且每份基金份额可供分配利润金额高于0.05元(含),则以该交易日为基金收益分配基准日,由基金管理人确定权益登记日,对权益登记日日终登记在册的基金份额持有人进行收益分配。

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 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

本报告期内,本基金托管人在对创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金的管理人--创金合信基金管理有限公司在创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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	79,051,263.87	46,744,009.90
结算备付金	-	13,284,987.34
存出保证金	65,829.32	58,751.79
交易性金融资产	90,026,180.51	154,767,328.97
其中:股票投资	90,026,180.51	154,767,328.97
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	140,182,272.24
应收利息	15,908.88	-11,143.08
应收股利	-	-
应收申购款	266,543.64	988.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	169,425,726.22	355,027,195.30

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	9,008.74	18,694.21
应付管理人报酬	207,402.45	462,699.01
应付托管费	34,567.07	77,116.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	110,768.54	90,778.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	95,972.68	280,000.00
负债合计	457,719.48	929,287.97
所有者权益:		
实收基金	173,215,091.29	392,914,844.06
未分配利润	-4,247,084.55	-38,816,936.73
所有者权益合计	168,968,006.74	354,097,907.33
负债和所有者权益总计	169,425,726.22	355,027,195.30

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9755元,基金份额总额173,215,091.29份。

6.2 利润表

会计主体:创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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01月01日至2018年06月30日
一、收入	47,213,668.74	-29,435,282.49
1.利息收入	774,344.19	4,337,805.05
其中:存款利息收入	280,370.86	705,260.49
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	493,973.33	3,632,544.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	9,781,648.79	-6,600,467.10
其中:股票投资收益	8,798,818.95	-7,084,035.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	982,829.84	483,568.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	36,650,620.89	-27,554,850.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7,054.87	382,230.22
减:二、费用	2,846,801.16	4,770,794.31
1. 管理人报酬	2,036,130.66	3,639,482.80
2. 托管费	339,355.09	606,580.44
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	375,189.31	385,685.35
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	96,126.10	139,045.72
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	44,366,867.58	-34,206,076.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	44,366,867.58	-34,206,076.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金

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)	392,914,844.06	-38,816,936.73	354,097,907.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,366,867.58	44,366,867.58
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)	-219,699,752.77	-9,797,015.40	-229,496,768.17
其中:1.基金申购款	2,413,854.62	-8,807.48	2,405,047.14
2.基金赎回款	-222,113,607.39	-9,788,207.92	-231,901,815.31
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)	173,215,091.29	-4,247,084.55	168,968,006.74
项 目	上年度可比期间 2018年01月01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)	631,378,610.11	940,195.25	632,318,805.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-34,206,076.80	-34,206,076.80
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)	-195,312,581.64	1,280,245.76	-194,032,335.88
其中:1.基金申购款	1,513,470.30	1,631.50	1,515,101.80
2.基金赎回款	-196,826,051.94	1,278,614.26	-195,547,437.68
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)	436,066,028.47	-31,985,635.79	404,080,392.68

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

创金合信优选回报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]1742号《关于准予创金合信港股通香港内地股50指数证券投资基金注册的批复》和关于将基金变更注册为本基金的证监许可[2017]1258号《关于准予创金合信港股通香港内地股50指数证券投资基金变更注册的批复》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《创金合信优选回报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822,731,554.84元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第324号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为822,948,446.55份基金份额,其中认购资金利息折合216,891.71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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信优选回报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、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(包括同业存单等)、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%。

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》、《创金合信优选回报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。

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,增额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
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,036,130.66	3,639,482.80
其中:支付销售机构的客户维护费	979,612.76	2,133,324.34

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷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01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	339,355.09	606,580.44

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。

6.4.8.3 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

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。

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01月01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
中国工商银行股份有限公司	79,051,263.87	229,560.74	134,400,649.01	514,343.73

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 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	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新发流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

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89,969,203.97元,属于第二层次的余额为56,976.54元,无属于第三层次的余额(2018年12月31日:第一层次154,717,183.17元,第二层次50,145.80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	90,026,180.51	53.14
	其中:股票	90,026,180.51	53.14
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	79,051,263.87	46.66
8	其他各项资产	348,281.84	0.21
9	合计	169,425,726.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	114,760.85	0.07
C	制造业	44,546,112.26	26.36
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	17,121,286.72	10.13
G	交通运输、仓储和邮政业	8,257,210.86	4.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	13,697,498.54	8.11
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	6,249,707.52	3.70
S	综合	-	-
	合计	90,026,180.51	53.28

7.3 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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600861	北京城乡	812,040	6,902,340.00	4.08
2	600089	特变电工	892,724	6,472,249.00	3.83
3	600731	湖南海利	883,441	6,316,603.15	3.74
4	600757	长江传媒	914,332	6,226,600.92	3.69
5	600859	王府井	346,898	5,269,380.62	3.12
6	601333	广深铁路	1,619,892	5,232,251.16	3.10
7	600883	博闻科技	571,300	4,084,795.00	2.42
8	000519	中兵红箭	471,813	3,647,114.49	2.16
9	000521	长虹美菱	990,483	3,526,119.48	2.09
10	600888	新疆众和	714,800	3,495,372.00	2.07

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