创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)

其全管理人: 创全合信其全管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 送出日期:2018年08月29日

《1 重要提示 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 2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, 份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28日复核了本报告 、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 《四阙。 · 承诸以诚实信用、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。 主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 171及兵史斯。 本羊年度抵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 本报告中的务资料未控时上 本报告中的务资料未控时上

§ 2 基金简介 2.1 基金基本情况

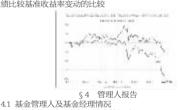
2.2 基金产品说明

2.3 基金管理人和基金托管 2.4 信息披露方 63 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 3.12 期末数据和 国共基金的邮种值 (1878) 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物11. 本期以公公依据实现收

益加上本期公允价值变动收益。 3.本基金合同生效日为2017年7月7日,无上年度可比期间。

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	-4.06%	0.81%	-7.27%	1.31%	3.21%	-0.50%
过去三个月	-4.75%	0.71%	-14.23%	0.99%	9.48%	-0.28%
过去六个月	-5.47%	0.76%	-16.00%	1.02%	10.53%	-0.26%
自基金合同生 效起至今	-3.74%	0.57%	-16.85%	0.85%	13.11%	-0.28%
3.2.2 自基	基金合同	+效以来	基金份额	累计净值	增长率变	动及其



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2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。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)共同出资设 立。公司注册资本1.7亿元人民市,股东出资情况为:第一创业证券股份有限公司出资11,900万元,占公司注册资本的70%;深圳市金合信投资 合伙企业(有限合伙)出资5.100万元,占公司注册资本的30%。

公司始终坚持"令户利益至上",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11只公募基金。截至2018年6月30日,本公

司共管理39只公募基金,其中混合型产品14只,指数型产品8只,债券型 产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只;管理的公募基金规模约

姓名	187.95	任本基金的 理)		证券从业	设知明	
		任职日期	离任日期	4-194		
王一兵	本基金基金終理、固定收益部总監	2017-07-1	-	14年	三一長光生、中国国籍。原川大 MIAA、1904年間上孔序制度下台 中为公司由州代表行指原中中省财 的工程。1907年间,是是一个人 的工程。1907年间,是是一个人 有效的工程。1907年间,是是一个人 有效的工程。1907年间,是一个人 是是一个人 是是一个人 是是一个人 是是一个人 是一个人 是一个人 是	
张荣	本基金基金	2017-07-1	-	8年	张荣先生,中国国籍,北京大学金融 硕士,2004年就职于展州最佳局从 银行简常工作,历任多家银行监管员 2010年加入第一创业证券资产管 8.历任金融行业研究主管,投资主 等联务,2014年8月加入创金合信基 管理有限公司担任高级研究员,现任 金经理。	
曹春林	本基金基金经理	2017-07-0	-	13年	番枠状を集中回路線、展上大学総子学生、1986年7月2日第二十年8日第一方、外部学工工作、2004年7月1日第一方、外部学工工作、2004年7月1日第一方、東京市場、1987年7日、1	

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

证券从业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

4.2 日连入列取日期四年基立区IT层外で16间では15097 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《证券投资其全信自城震管理办法》等有关注律法扣及**尽** 页实施准则、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 用、動观》以前,然后是中国是一种是一种。 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 《《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4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

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

权益方面,外部中美贸易摩擦加剧,对抗升级预期抬升,在过去金融 太紅杆的大环填下,企业融资环境转差,流动性压力增大。目前来看,以 去杠杆的大环填下,企业融资环境转差,流动性压力增大。目前来看,以 上因素暂未根本性动摇经济内生动力,企业盈利仍然处于较好的状态, 但股市流动性偏好增强,避险情绪抬升,导致股市整体波动性加大;

固收方面,上半年债券债券收益率整体震荡下行。4月央行宣布定向 降准以及6月末央行第二次降低降准的行为,预示着货币政策由中性偏 案向中性偏松转变。市场资金面预期迅速好转,短端收益率快速下行,利率债与高评级表现更好。受到表外融资收缩影响,整体社融增速降低,中 低资质企业再融资风险进一步加大,信用利差有所扩张。随后政策面进 信息及正显于两点内容是一步加大,由于自己的情况,可以是一种的微调,对冲表外收缩过快而导致社融快速下滑,市场风险偏好有所提升,中低平级信用债流动性有所恢复。

本产品将继续维持短久期、中高评级的债券投资策略,降低股票市场波动对产品净值的影响,提升产品流动性,更好的把握后续投资机会。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信鼎鑫客选定开混合基金份额净值为0.9626 本报告期内,基金份额净值增长率为-5.47%,同期业绩比较基准收

45 管理人对宏观经济,证券市场及行业走势的简要展望 43 自星人对本观运行、证券印加及打业还券的间接旅臺 向前着,债券市场的总体机会大于风险,下一阶段的优势品种可能 是优质信用债。基本面来看,短期经济可能会走弱,但出现失速的风险较 小。外部来说,基于政治利益诉求、特朗普政府推行的逆全球化等措施各 持续,中美贸易摩擦将不断,但在全球生产一体和全面对抗无益于美国 经济的根本逻辑,出口出现大幅下挫的可能性并不大。内部来说,政策仍 在推进结构性去杠杆,但考虑到政策的底线思维,目前已经开始针对信 用收缩出台相关措施,资管新规的力度已经有所放缓。银行表外收缩并 向表内扩张存在资本金、存款等阻碍仍可能不畅,对融资平台的融资约 思求的。所可是本語、行為學院的學院。 東,房地产棚放货币化安置的新变,都会构成对未来房地产。基建投资的 下行压力。不过,对于货币政策而言,利率水平维持中性偏宽,有利于降 低实体融资成本,支持实体经济发展。货币市场利率水平有望维持较为 宽松的状态。对信用债而言,政策预防信用过度收缩的措施,提升了优质

企业获得融资的能力,信用面总体得到改善,不过弱资质企业获取流动 性能力仍可能较差,发生信用风险的可能性未降低。因此,综合来看,年 正能力以可能以至,及王伯州从超过过能压不停用(k)。 (A)此,求日不省,从 内债市投资选择上条以中短人期为主,而信用债投资需要维持谨慎态 度,优选资质较好的发行人。本基金将继续秉承稳健的投资思路,合理配 置答立品和和合位,努力为投资者获取稳健优异的投资回报。

/ 而中科区证,另刀分別及有名称松层框以升切及风户时。 46 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

水基全水报告期未出现连续^一十个丁作日基全份额持有人数量不

本基金本报告期未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,本基金托管人产成的金合信鼎鑫等选定期开放混合型证券投资基金(LOF)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

本报告期内,创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金 (LOF) 的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信鼎鑫睿选 定期开放混合型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算 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,创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基 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

思究 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 信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金 (LOF)2018年半年度报告 中财务捐标、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: 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金

报告截止日:20	18年06月30日	
	本領法	

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
贵产:		
银行存款	4,862,856.56	3,064,306.58
古算备付金	5,196,256.60	5,178,800.15
学出保证金	20,883.48	46,680.22
2易性金融资产	296,918,483.27	388,343,892.88
其中:股票投资	106,104,876.47	111,360,612.48
基金投资	-	
贵券投资	190,813,606.80	276,983,280.40
贵产支持证券投资	_	-
贵金属投资	-	
行生金融资产	-	
买人返售金融资产	_	
立收证券清算款	990,096.11	335,821.98
立收利息	1,732,398.79	5,274,423.39
立收股利	-	-
立收申购款	-	-
並延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
货产总计	309,720,974.81	402,243,925.17
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
5. 债:		
印用借款	-	
2·易性金融负债	-	-
行生金融负债	-	-
安出回购金融资产款	98,799,877.50	181,754,028.11
位付证券清算款	2,557,711.38	27,428.46
立付赎回款	-	-
並付管理人报酬	262,933.36	280,450.75
並付托管費	43,822.25	46,741.78
立付销售服务费	-	_
並付交易费用	115,982.45	45,358.40
立交税费	17,025.51	-
位付利息	28,033.04	161,053.20
立付利润	_	-
並延所得税负债	-	
は他负债	133,429.92	149,500.00
近债合计	101,968,815.41	182,464,560.70
F有者权益:		
以收基金	215,825,03250	215,825,032.50
未分配利润	-8,062,873.10	3,954,331.97
折有者权益合计	207,762,159.40	219,779,364.47
	,	,

2.本基金合同生效日为2017年7月7日,无上年度可比期间。 62 利润夷

会计主体: 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	-7,105,823.73
1.利息收入	4,624,585.68
其中:存飲利息收入	55,351.90
债券利息收入	4,569,233.75
资产支持证券利息收入	-
买人返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	975,780.93
其中:股票投资收益	54,193.26
基金投资收益	-
债券投资收益	-300,238.44
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	1,221,826.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"号 填列)	-12,706,190.30
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	4,911,381.38
1. 管理人报酬	1,643,601.53
2. 托管费	273,933.57
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	390,458.51
5. 利息支出	2,452,063.97
其中: 卖出回购金融资产支出	2,452,063.97
6. 税金及附加	11,67230
7. 其他费用	139,651.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填 列)	-12,017,206.07
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-12,017,205.07

注:本基金合同生效日为2017年7月7日,无上年度可比期间。 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

			单位:人民币:
项目	2018	本期 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)	215,825,032.50	3,954,331.97	219,779,364.47
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数(本期利润)	-	-12,017,205.07	-12,017,205.07
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)	-	-	_
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同生效日为2017年7月7日,无上年度可比期间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

6.4.1 基金基本情况 创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)(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]151号《关于准予创金合信鼎鑫睿洗定期开放混合型证券投资基 金(LOF)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《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券 投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式, 及风暴或记忆,强速运行以及以名为多条。华基亚为关约至足别了成八人 存线期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民而215, 699,712.96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316号验资报告予以验证。经向中国证监会备案。《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》于2017年7月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为215,825, 033.02份基金份额。其中认购资金利息折合125.320.06 份基金份额。本 商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行"),登记机构为中国证券 登记结算有限责任公司。

根据《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》的相关规定。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至18 个月念18个月后的对应日止,若该日的次日为非工作日,则该封闭期 结束日延长至下一工作日的前一日。下一个封闭期为首个开放期结束日 的次一工作日起至18个月后的对应日的期间,以此类推。本基金在封闭 期内不力理申购与赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所以下简称"上交所"转让基金份额。

是上交所[2017]324号文章核页语。本基金32.663,801.00份基金份额于2017年9月18日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后

根据(中华人民共和国证券投资基金法》和《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》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 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、可转换债 条 可交換债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融行生品(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的相关规定)。本基金的业绩比较 基准为:中证定向增发事件指数收益率×75%+中债总指数(全价)收益

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》、 《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金(LOF)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。

6.4.3 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 设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

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

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

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。

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总 局关于证券投资基金税收政策的通知》,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》及其他 [2016]70号《大丁亚融创时间型任米亭中国优级采印外元通知》及其记相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下: (1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征

收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券 以后周,不证从各些代。对证分对及基础目是八色用基金之类似条。以的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税政为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收 人免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征

(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 ,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

(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 人应纳税所得额:持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计 人应纳税所得额;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 持股时间自解禁口起计算,解禁前取得的股息 红利收入继续新减 按50%计人应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得

(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 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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 第一创业证券股份有限公司("第一创业证券")

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无应付关联方的佣金。 6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

其中,支付價值和規約客戶項的要 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理

单位:人民币元

费的计算方法如下: H=E×1.5%-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,由基金管理 人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2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、 公休假等,支付日期顺延 6.4.8.2.2 基金托管费

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。 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 金金九百五号日月月,20日新日上号月7月、12月2日,12年至日日 人与基金托曾人双万核对无误后,基金托曾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

1.公怀日等,又以日对制度。 64.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交

64.8.4 各关联方投资本基金的情况 64.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

, 本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

主: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 本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券 648.7 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 本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。 6.4.9 期末(2018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

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 截至木报告期末2018年6月30日止 木基全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4,999,877.50元,是以如下债券 作为抵押:

金额单位:人民币元 数量(张) 期末估值

交易所市场债券正回购 34932 截至本报告期末2018年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回 购交易形成的卖出回购证券款余额93,800,000.00元,于2018年7月2日 至2018年7月15日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证 券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转人质押库的债券,按证

券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 (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

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 第二目次·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

cl非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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139,073,468.12元,第二层次的余额为157,845,015.15元,无属于第三层次的余额(2017年12 月31日:第一层次139,984,125.40元,第二层次248,359,767.45元,无 属于第三层次的余额)。 (ii)公允价值所属层次间的重大变动

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人第一层次;并根据估值调整中采用的不可观 察输人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

F2018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(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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 木基全木报告期未投资股指期货 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持有贵金属。

本基金本报告期末未持有权证

本基金本报告期未投资国债期货。

77 期末按公子

支持证券投资明细

贵金属投资明细

、公司副总裁谢志霞先生违反《证券法》第四十七条、《上海证券 交易所股票上市规则》第3.17条《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》第十三条的相关规定以及 违反了其在《高级管理人员声明及承诺书》中的承诺:

二、三一直工董事会知悉后高度重视,对谢志霞先生违规买卖股票行为进行了严厉的批评教育,并没收本次违规买卖股票所得收益人民币 13659元同时处以5000元人民币罚款: 三、公司将要求全体董事、监事和高级管理人员以此为戒,严格遵循 相关法规与内部规章制度规定,严格规范买卖公司股票的行为,加强证券账户的管理,坚决杜绝此类事项的再次发生。

乔縣广的百堪, 等於任理瓜朵爭級的中心及生。 本基金投研人员分析认为, 三一重工本次高级管理人员违规买卖公司股票行为乃个人行为, 同时其交易量较小对于当时市场公允价值并无 重大影响,也并未影响三一重工公司整体基本面,维持对于三一重工原有的经营情况判断。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三一重工,代码600031

2018年半年度报告摘要

融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

7.1 期末基金资产组合情况

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品

号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定、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

3%的担似辛纳对自属性。从其目广阳性2016年1月1日间是自身往开及生的增值税成成行为,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。

90号《关于租人固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部

《7 投资组合报告

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

10 | 600104 | 上汽集図 | 52,900 | 1,850,971.00 | 0.89 | 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

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

75 期末按债券品种分类的债券投资组合

主: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

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

介值占基金资产净值比例大小排序的前

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

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

7.12 投资组合报告附注 7.12.1 2017年12月29日,三一重工股份有限公司(下称"三一重工 股票代码:600031) 发布关于高级管理人员违规买卖公司股票的公

金额单位:人民币元

k期累计卖出金额

k期累计买人金额

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

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

此外,财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]

(3)除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的

金额单位:人民币元

额单位:人民币元

金额单位:人民币元

日外定,员自广西区 2017年6月30日颁布的财税[2017]56 根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56

(2)增值税

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金額
1	存出保证金	20,883.4
2	应收证券清算款	990,096.1
3	应收股利	
4	应收利息	1,732,3987
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	2,743,3783

-	-			其他应收款		
-	-			待摊费用		
_	-			其他		
88	2,743,378.38			ìt	9 🖆	
	H	T转换债券明纸	上于转股期的同	期末持有的如	7.12.4	
汗元	金额单位:人民市	氢				
J	占基金资产净值比例	公允价值	债券名称	债券代码	序号	

7125 期末前十夕股票由左在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

《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 8.2 期末上市基金前十名持有人

8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 8.4 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

69 开放式基金份额变动 单位:份

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 本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人

€10 重大事件揭示

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 10.3 伊及雅亚自生人、基亚州广、雅亚北自亚另市外位 本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。 10.4 基金投资策略的改变

10.4 基金及贡柬昭的改变 本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。 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。 在报告期付外海並不及時交替用中方所。 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,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到

监管部门稽查或处罚等情况。

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

			股票交易		应支付该券商的佣金		
	券商名称	交易单元 数量	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	备注
	华安证券	2	-	-	-	-	-
	恒泰证券	2	-	-	-	-	-
	平安证券	2	45,500,578.44	14.38%	32,804.86	15.89%	-
	广州证券	2	727,047.62	0.23%	313.57	0.15%	-
	太平洋证券	2	113,990,688.18	36.02%	82,206.45	39.83%	-
	中金公司	2	-	-	-	-	-
	第一创业证券	2	-	-	-	-	-
	兴业证券	2	-	-	-	-	-
	招商证券	2	-	-	-	-	-
	东吴证券	2	-	-	-	-	-
	江海证券	2	-	-	-	-	-
	国信证券	2	-	-	-	-	-
	广发证券	2	-	-	-	-	-
	申万宏源	2	-	-	-	-	-
	光大证券	2	-	-	-	-	-
	西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
	中信建投证券	2	-	-	-	-	-
専明	东兴证券	2	-	-	-	-	-
	中泰证券	2	-	-	-	-	-
玩	长江证券	2	-	-	-	-	-
376	中银国际证券	2	-	-	-	-	-
	华泰证券	2	-	-	-	-	-
	方正证券	2	71,796,202.78	22.69%	30,237.22	14.65%	-
	天风证券	2	-	-	-	-	-
	中投证券	2	-	-	-	-	-
	国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
	银河证券	4	84,444,170.37	26.68%	60,854.69	29.48%	-
	-A- 63-130 Ma						

(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 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 例报音及其它引引取由,开辟识别企业以及由引行及至小,是它以引 所究报告。 (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

注:交易单元的选择标准和程序

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。 本基金报告期内新增方正证券、中金公司、江海证券、恒泰证券4家

券商的8个交易单元,退租金元证券的2个交易单元。 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

全麵单位,人民币元

宏证券 州证券 建投证券 E证券 投证券 可证券

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

t 、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 同内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险; 比例达到或超过基合份额负额20%的单一投资者大额赎回引为巨额赎回,将可

理人的管理造成影响; 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 /资运作; (4) 因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归人基金资产,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,不能通见存线条件,可能导致基金合同终止,消算等风险。 本基金管理人特建立完善的风险管理机制,以有效防止上发配险。最大和股份原导基金份额持有人的

本报告期内,未出现影响投资者决策的其他重要信息。

11.2 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

二〇一八年八月二十九日