

创金合信基金管理有限公司关于旗下指数基金编制方法及查询路径的公告

为落实《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》（2021年2月1日起施行）的规定，创金合信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下指数基金的相关指数编制方法及查询路径如下：

1、创金合信中证红利低波动指数发起式证券投资基金

基金主代码：005561

基金成立时间：2018-04-26

标的指数：中证红利低波动指数

指数编制方案：中证红利低波动指数由中证指数有限公司编制，中证红利低波动指数选取 50 只流动性好、连续分红、红利支付率适中、每股股息正增长以及股息率高且波动率低的股票作为指数样本股，采用股息率加权，以反映分红水平高且波动率低的股票的整体表现。

指数编制方法：

（1）样本空间：中证红利低波动指数的样本空间由满足以下条件的沪深 A 股构成：1）过去 3 年连续现金分红且每年的税后现金股息率均大于 0；2）过去一年日均总市值排名在全部 A 股的前 80%；3）过去一年日均成交金额排名在全部 A 股的前 80%。

（2）选样方法：1）对样本空间的股票，计算其最近一年的红利支付率和过去 3 年的每股股利增长率，剔除支付率过高或者为负的股票（红利支付率过高：支付率排名在样本空间前 5%），剔除增长率非正的股票；2）计算剩余股票过去 3 年的平均税后现金股息率和过去一年的波动率；按照过去 3 年平均税后现金股息率降序排列，挑选排名居前的 75 只股票；3）将 2）中的剩余股票按照过去一年波动率升序排列，挑选排名居前的 50 只股票作为指数样本股。

指数查询路径：中证指数有限公司网站：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/H30269>

2、创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金

基金主代码：005567

基金成立时间：2018-02-07

标的指数：MSCI 中国 A 股国际指数

指数编制方案：MSCI 指数基于全球可投资市场指数 (GIMI) 编制，而这一编制方法广泛为国际投资者所接受。

指数编制方法：

(1) 样本空间：除去 ST 股外在上证交易所和深证交易所上市的所有 A 股。

(2) 选样方法：1) 对股票样本空间的每个股票运用可投资性筛选标准；2) 确定各个 A 股大、中、小盘最小规模要求及目标公司数目，平衡两个目标：① 新兴市场规模一致性, ② A 股市场覆盖率；3) 根据各规模区段内目标公司数量，最小规模要求以及缓冲区，将公司划入相应的规模区段；4) 对已经划入各市场各规模区段的公司，再次进行可投资性标准审查后，确定最终收入指数的股票。

指数查询路径：MSCI 网站：<https://www.msci.com/zh/msci-china-a-international-indexes>

3、创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

基金主代码：003646

基金成立时间：2016-12-22

标的指数：中证 1000 指数

指数编制方案：中证 1000 指数由中证指数有限公司编制，中证 1000 指数选取中证 800 指数样本股以外的规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。

指数编制方法：

(1) 样本空间：中证 1000 行业指数系列样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：1) 上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；2) 不含 ST 股票、*ST 股票、暂停上市股票。

(2) 选样方法：1) 剔除样本空间内中证 800 指数样本股及最近一年日均

总市值排名前 300 名的股票；2) 将样本空间股票按照过去一年（新股为上市以来）的过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票；3) 将剩余股票按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 1000 名的股票作为中证 1000 指数样本股。

指数查询路径：中证指数有限公司网站：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000852>

4、创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

基金主代码：002311

基金成立时间：2015-12-31

标的指数：中证小盘 500 指数

指数编制方案：中证小盘 500 指数由中证指数有限公司编制，中证小盘 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。

指数编制方法：（1）样本空间：中证小盘 500 指数样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：非创业板股票：上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来日均 A 股总市值在全部沪深 A 股（非创业板股票）中排在前三位；创业板股票：上市时间超过三年。非 ST、*ST 股票，非暂停上市股票。

（2）选样方法：1) 在样本空间中剔除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票；2) 将剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票；3) 将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票组成中证 500 指数样本股。

指数查询路径：中证指数有限公司网站：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000905>

5、创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

基金主代码：002310

基金成立时间：2015-12-31

标的指数：沪深 300 指数

指数编制方案：沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，沪深 300 指数是由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，于 2005 年 4 月 8 日正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。

指数编制方法：（1）样本空间：沪深 300 指数样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：非创业板股票：上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来日均 A 股总市值在全部沪深 A 股（非创业板股票）中排在前 30 位；创业板股票：上市时间超过三年。非 ST、*ST 股票，非暂停上市股票。

（2）选样方法：沪深 300 指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、股票价格无明显异常波动或市场操纵的公司：1）计算样本空间内股票最近一年（新股为上市第四个交易日以来）的 A 股日均成交金额与 A 股日均总市值；2）对样本空间股票在最近一年的 A 股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 50%的股票；3）对剩余股票按照最近一年 A 股日均总市值由高到低排名，选取前 300 名股票作为指数样本。

指数查询路径：中证指数有限公司网站：<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000300>

6、创金合信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

基金主代码：005838

基金成立时间：2020-05-21

标的指数：中债-1-3 年政策性金融债指数

指数编制方案：中债-1-3 年政策性金融债指数隶属于中债总指数族分类，该指数成分券包括在境内公开发行且上市流通的待偿期 0.5 至 3 年（包含 0.5 和 3 年）的政策性银行债，可作为投资该类债券的业绩基准和标的指数。

指数编制方法：

（1）债券种类：政策性银行债

（2）上市地点：全国银行间债券市场

（3）托管余额/发行量：上市 1 年内的债券：发行量无限制上市 1 年及以上的债券：发行量大于或等于 200 亿元

（4）债券剩余期限：0.5 年-3 年（包含 0.5 和 3 年）

(5) 债券币种：人民币

(6) 付息方式：付息式固定利率

(7) 上市期限：上市 7 年内

(8) 含权债：不包含含权债

(9) 取价源：以中债估值为参考(价格偏离度参数为 0.1%)，优先选取合理的最优双边报价中间价，若无则取合理的银行间市场加权平均结算价，再无则直接采用中债估值价格。

指数查询路径：中国债券信息网站：http://yield.chinabond.com.cn/cbweb-mn/indices/single_index_query?locale=zh_CN

7、创金合信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

基金主代码：008125

基金成立时间：2019-11-21

标的指数：中债-1-3 年国开行债券指数

指数编制方案：中债-1-3 年国开行债券指数隶属于中债总指数族分类，该指数成分券包括国家开发银行在境内公开发行且上市流通的待偿期 0.5 至 3 年(包含 0.5 年和 3 年)的政策性银行债，可作为投资该类债券的业绩基准和标的指数。

指数编制方法：

(1) 债券种类：政策性银行债

(2) 发行人：国家开发银行

(3) 上市地点：全国银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所

(4) 托管余额/发行量：无限制

(5) 债券剩余期限：0.5 年-3 年(包含 0.5 年和 3 年)，含权债剩余期限按计算日中债估值推荐方向选取

(6) 债券币种：人民币

(7) 付息方式：付息式固定利率

(8) 上市期限：无限制

(9) 含权债：包含含权债

(10) 取价源：以中债估值为参考(价格偏离度参数为 0.1%)，优先选取合

理的最优双边报价中间价，若无则取合理的银行间市场加权平均结算价或交易所市场收盘价，再无则直接采用中债估值价格。

指数查询路径：中国债券信息网站：http://yield.chinabond.com.cn/cbweb-mn/indices/single_index_query?locale=zh_CN

投资者可通过本公司的客服热线或网站咨询有关详情：

创金合信基金管理有限公司

客服电话：400-868-0666

官方网址：www.cjxfund.com

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书和产品资料概要等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

创金合信基金管理有限公司

2021年1月30日