

创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016年6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：2016年8月26日

§ 1 重要提示

1.1 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2016年8月19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2016年01月22日起至06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 创金合信量化多因子股票 |
| 基金主代码 | 002210 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年1月22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 | 111,016,480.77份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用"自上而下"的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。</p> <p>本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据风险约束、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证500指数收益率×90%+2% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

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 | 洪渊 |
| | 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（2016年1月22日至2016年6月30日） |
|---------------|----------------------------|
| 本期已实现收益 | 8,229,690.53 |
| 本期利润 | 10,702,186.72 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1287 |
| 本期加权平均净值利润率 | 12.11% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1180 |
| 期末基金资产净值 | 124,565,366.11 |
| 期末基金份额净值 | 1.122 |

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.期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数,表

中的"期末"均指报告期最后一日，即6月30日。

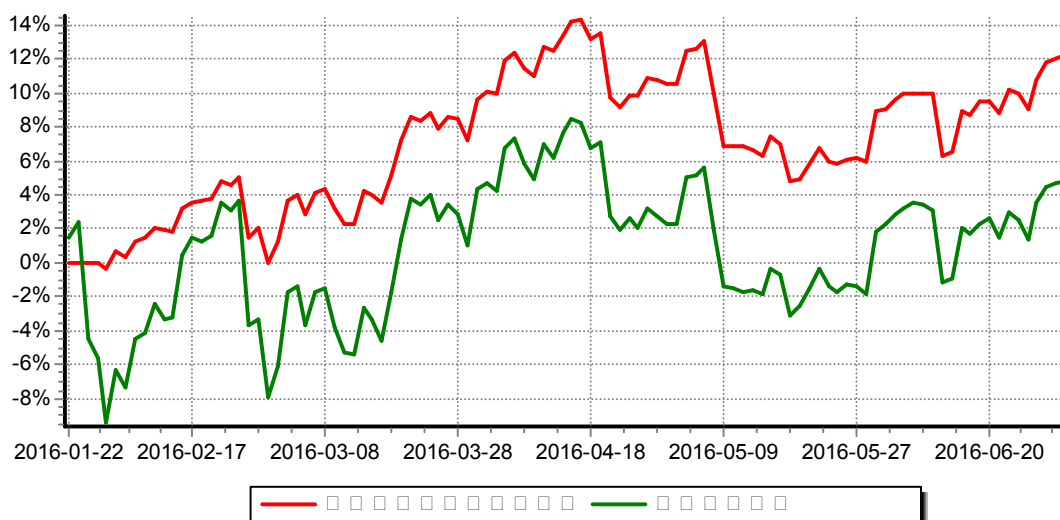
4.本基金合同生效日为2016年1月22日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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 | 3.03% | 1.10% | 2.85% | 1.39% | 0.18% | -0.29% |
| 过去三个月 | 1.91% | 1.14% | 0.10% | 1.49% | 1.81% | -0.35% |
| 自基金合同生效日起至今（2016年01月22日-2016年06月30日） | 12.20% | 1.12% | 4.77% | 1.98% | 7.43% | -0.86% |

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1.7亿元人民币，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“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。

报告期内，本公司共发行6只公募基金。截至2016年6月30日，本公司共管理13只公募基金，其中混合型产品4只、指数型产品2只、债券型产品5只、股票型产品1只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约68亿元。

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------|-------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 程志田 | 基金经理、量化投资部总监 | 2016年1月22日 | — | 9 | 程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监。 |
| 庞世恩 | 基金经 | 2016年1月 | — | 5 | 庞世恩先生，中国国籍， |

| | | | | | |
|--|---|-----|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 理 | 25日 | | | 中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。 |
|--|---|-----|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》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。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

本报告期内，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）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现异常交易情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

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

回顾2016年上半年，年初受投资者恐慌情绪以及熔断引起的流动性匮乏影响，一月份A股经历了一轮恐慌性下跌，之后股市以震荡反弹为主，投资者情绪在二季度震荡筑底的过程中慢慢修复；另一方面，部分优质个股已经在二季度获得不错的涨幅，显示投资者信心在恢复；另外，受供给侧改革影响，相关行业受益，其中个股股价表现具备超额收益。

在投资管理上，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，多因子选股模型提供了持续稳健的Alpha；另一方面，量化择时模型准确把握了一月底和二月底两次抄底机会。本基金稳健运行，在有效控制回撤的同时，获得了较为可观的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率12.2%，同期业绩比较基准收益率为4.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A股市场在1季度的调整使风险得到了一定的释放，市场大部分的悲观预期已经充分反映，目前市场点位下具有较大的安全边际；在货币宽松的大环境下，人民币汇率也相对企稳，宏观经济企稳的可能性增大，市场有望迎来修复性行情。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值，同时看好“深港通”等主题投资机会。综合来看，下半年市场可能呈现震荡上行走势。

看好的版块，一是涉及供给侧改革的行业，如有色钢铁水泥等，二是去年跌幅较大的创业板等中小股票，三是主题投资机会，如深港通等。供给侧改革是一个势在必行的改革，对国家修正产能过剩，减小无效投资有相当的正面意义，反应在资本市场是有些行业和公司将会得到重新估值，带来重估的机会；而创业板等代表经济转型的公司代表了中国经济的未来，这一逻辑将会贯穿未来很长时间，特别是经历了充分调整之后；主题投资也是贯穿未来一段时间的投资热点，可密切关注。

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。

公司在风险控制办公会下设估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金

估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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，本基金托管人在对创金合信量化多因子股票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，创金合信量化多因子股票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量化多因子股票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，创金合信量化多因子股票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量化多因子股票型证券投资基金2016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：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2016年6月30日 |
|-----------------|---------------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 16,839,900.93 |
| 结算备付金 | 1,672,739.78 |
| 存出保证金 | 30,709.13 |
| 交易性金融资产 | 105,998,921.05 |
| 其中：股票投资 | 105,998,921.05 |
| 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 | — |
| 应收利息 | 2,749.07 |
| 应收股利 | — |
| 应收申购款 | 3,205,096.37 |
| 递延所得税资产 | — |
| 其他资产 | — |
| 资产总计 | 127,750,116.33 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016年6月30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 | 1,974,736.94 |

| | |
|---------------|----------------|
| 应付赎回款 | 807,351.22 |
| 应付管理人报酬 | 113,199.24 |
| 应付托管费 | 18,866.56 |
| 应付销售服务费 | — |
| 应付交易费用 | 199,125.11 |
| 应交税费 | — |
| 应付利息 | — |
| 应付利润 | — |
| 递延所得税负债 | — |
| 其他负债 | 71,471.15 |
| 负债合计 | 3,184,750.22 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 111,016,480.77 |
| 未分配利润 | 13,548,885.34 |
| 所有者权益合计 | 124,565,366.11 |
| 负债和所有者权益总计 | 127,750,116.33 |

注：1.报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.122元，基金份额总额111,016,480.77份。

2.本财务报表的实际编制期间为2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月22日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期2016年1月22日至2016年6月30日 |
|-------------|-------------------------|
| 一、收入 | 11,895,294.16 |
| 1.利息收入 | 247,043.63 |
| 其中：存款利息收入 | 62,644.83 |
| 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 | 184,398.80 |

| | |
|----------------------------|----------------------|
| 入 | |
| 其他利息收入 | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 7,919,422.49 |
| 其中：股票投资收益 | 7,447,134.27 |
| 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 | 472,288.22 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 2,472,496.19 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | — |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 1,256,331.85 |
| 减：二、费用 | 1,193,107.44 |
| 1. 管理人报酬 | 575,752.40 |
| 2. 托管费 | 95,958.76 |
| 3. 销售服务费 | — |
| 4. 交易费用 | 450,946.70 |
| 5. 利息支出 | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | — |
| 6. 其他费用 | 70,449.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 10,702,186.72 |
| 减：所得税费用 | — |
| 四、净利润（净亏损以“-” | 10,702,186.72 |

| | |
|-------|--|
| ”号填列) | |
|-------|--|

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2016年1月22日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2016年1月22日至2016年6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) | 202,639,215.47 | — | 202,639,215.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 10,702,186.72 | 10,702,186.72 |
| 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） | -91,622,734.70 | 2,846,698.62 | -88,776,036.08 |
| 其中：1.基金申购款 | 95,837,134.61 | 9,468,374.72 | 105,305,509.33 |
| 2.基金赎回款 | 187,459,869.31 | -6,621,676.10 | -194,081,545.41 |
| 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） | 111,016,480.77 | 13,548,885.34 | 124,565,366.11 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至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

创金合信量化多因子股票型证券投资基金(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]第2238号《关于准予创金合信量化多因子股票型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《创金合信量化多因子股票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202,600,123.85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086号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》于2016年1月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为202,639,215.47份基金份额,其中认购资金利息折合39,091.62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《创金合信量化多因子股票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、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(权证、股指期货、股票期权等)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:中证500指数收益率 \times 90%+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2016年8月25日批准报出。

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》、《创金合信量化多因子股票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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始

确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余

额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、每一基金份额享有同等分配权；4、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召

开基金份额持有人大会审议；5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

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

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

| 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、基金销售机构 |
| 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、基金销售机构 |
| 深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人股东 |

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 2016年1月22日至2016年6月30日 | |
|--------|-----------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 121,038,725.98 | 33.51% |

6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月22日至2016年6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 | 87,235.84 | 30.46% | — | — |

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。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期2016年1月22日至2016年6月30日 | |
|--------|-------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 第一创业证券 | 1,149,000,000.00 | 67.99% |

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 2016年1月22日至2016年6月30日 |
|----|-----------------------------|
| | |

| | |
|-----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 575,752.40 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 320,378.48 |

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值*1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-----------------------|
| | 2016年1月22日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 95,958.76 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

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

无。

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

| | |
|----------------------------|---|
| 基金合同生效日（2016年1月22日）持有的基金份额 | — |
|----------------------------|---|

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

报告期末无基金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 | |
|--------|-----------------------|-----------|
| | 2016年1月22日至2016年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 16,839,900.93 | 48,987.04 |

| | | |
|------|--|--|
| 活期存款 | | |
|------|--|--|

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

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末（2016年6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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

| 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 | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 |
|--------|------|------------|---------|------------|------------|------------|--------|------------|------------|
| 600203 | 福日电子 | 2016-06-30 | 临时停牌 | 13.80 | 2016-07-01 | 13.25 | 38,400 | 423,518.59 | 529,920.00 |
| 600295 | 鄂尔多斯 | 2016-06-30 | 筹划非公开发行 | 7.89 | 2016-07-14 | 8.46 | 51,000 | 394,521.00 | 402,390.00 |
| 600860 | 京城股份 | 2016-06-27 | 重大事项 | 8.43 | 2016-07-05 | 8.85 | 37,700 | 332,517.07 | 317,811.00 |
| 002621 | 三垒股份 | 2016-06-20 | 重大事项 | 22.00 | 2016-07-04 | 21.00 | 14,200 | 246,809.90 | 312,400.00 |
| 000916 | 华北高速 | 2016-06-24 | 重大事项 | 5.01 | | — | 58,800 | 266,220.29 | 294,588.00 |
| 600121 | 郑州煤电 | 2016-06-17 | 重大事项 | 4.80 | 2016-07-01 | 5.05 | 58,900 | 272,716.00 | 282,720.00 |
| 000639 | 西王食品 | 2016-05-27 | 重大事项 | 14.12 | | — | 19,400 | 262,918.50 | 273,928.00 |
| 000498 | 山东路桥 | 2016-06-20 | 重大事项 | 5.76 | 2016-07-04 | 6.11 | 46,700 | 276,413.00 | 268,992.00 |
| 000407 | 胜利股份 | 2016-05-23 | 重大事项 | 6.73 | | — | 38,700 | 256,063.60 | 260,451.00 |
| 600475 | 华光股份 | 2016-05-18 | 重大事项 | 14.85 | | — | 15,800 | 222,911.39 | 234,630.00 |
| 002120 | 新海股份 | 2016-05-23 | 重大事项 | 20.48 | 2016-07-15 | 22.53 | 11,000 | 257,858.64 | 225,280.00 |
| 002101 | 广东 | 2016-04-29 | 重大事项 | 21.62 | | — | 9,300 | 178,936.85 | 201,066.00 |

| | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|--------|------|------------|------|--------|------------|------------|
| | 鸿图 | | | | | | | | |
| 000636 | 风华高科 | 2016-03-15 | 重大事项 | 8.84 | 2016-07-13 | 9.72 | 20,700 | 157,919.16 | 182,988.00 |
| 000537 | 广宇发展 | 2016-04-13 | 重大资产重组 | 8.01 | 2016-07-20 | 8.81 | 21,500 | 146,577.53 | 172,215.00 |
| 300225 | 金力泰 | 2016-03-22 | 重大事项 | 7.12 | 2016-07-08 | 7.58 | 24,100 | 143,386.49 | 171,592.00 |
| 002447 | 壹桥海参 | 2016-03-09 | 重大事项 | 7.19 | 2016-07-04 | 7.16 | 22,500 | 142,103.23 | 161,775.00 |
| 600035 | 楚天高速 | 2016-04-11 | 重大事项 | 5.06 | 2016-08-01 | 5.57 | 30,700 | 161,175.00 | 155,342.00 |
| 000608 | 阳光股份 | 2016-03-08 | 重大事项 | 5.30 | 2016-07-14 | 5.12 | 29,300 | 144,429.18 | 155,290.00 |
| 000818 | 方大化工 | 2016-02-05 | 重大资产重组 | 6.57 | | — | 21,000 | 119,214.00 | 137,970.00 |

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金于本期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有交易所市场债券正回购。

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2016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101,257,573.05元，属于第二层次的余额为4,741,348.00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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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2016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。

(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)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（元） | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 105,998,921.05 | 82.97 |
| | 其中：股票 | 105,998,921.05 | 82.97 |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 18,512,640.71 | 14.49 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,238,554.57 | 2.54 |
| 8 | 合计 | 127,750,116.33 | 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 | 161,775.00 | 0.13 |
| B | 采矿业 | 1,104,536.00 | 0.89 |
| C | 制造业 | 63,710,697.12 | 51.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,914,681.30 | 6.35 |
| E | 建筑业 | 3,156,197.20 | 2.53 |
| F | 批发和零售业 | 11,493,435.03 | 9.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,234,235.50 | 5.81 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | — | — |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 8,014,751.50 | 6.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 782,203.00 | 0.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 866,342.00 | 0.70 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 793,853.00 | 0.64 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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 | 766,214.40 | 0.62 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 105,998,921.05 | 85.10 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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 | 601313 | 江南嘉捷 | 36,700 | 531,416.00 | 0.43 |
| 2 | 600203 | 福日电子 | 38,400 | 529,920.00 | 0.43 |
| 3 | 002495 | 佳隆股份 | 67,200 | 510,720.00 | 0.41 |
| 4 | 300337 | 银邦股份 | 64,300 | 506,041.00 | 0.41 |
| 5 | 002003 | 伟星股份 | 32,300 | 504,849.00 | 0.41 |
| 6 | 002158 | 汉钟精机 | 40,300 | 496,899.00 | 0.40 |
| 7 | 002455 | 百川股份 | 50,300 | 495,958.00 | 0.40 |
| 8 | 002430 | 杭氧股份 | 53,300 | 495,690.00 | 0.40 |
| 9 | 000531 | 穗恒运 A | 40,400 | 493,688.00 | 0.40 |
| 10 | 002255 | 海陆重工 | 56,900 | 489,909.00 | 0.39 |

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.c.jhxfund.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 | 601339 | 百隆东方 | 850,650.45 | 0.68 |
| 2 | 002566 | 益盛药业 | 825,417.00 | 0.66 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 3 | 000422 | 湖北宜化 | 822,565.00 | 0.66 |
| 4 | 000708 | 大冶特钢 | 807,467.29 | 0.65 |
| 5 | 002233 | 塔牌集团 | 775,417.45 | 0.62 |
| 6 | 000419 | 通程控股 | 769,377.12 | 0.62 |
| 7 | 600261 | 阳光照明 | 768,842.00 | 0.62 |
| 8 | 000692 | 惠天热电 | 761,857.81 | 0.61 |
| 9 | 600162 | 香江控股 | 760,731.05 | 0.61 |
| 10 | 002495 | 佳隆股份 | 714,078.52 | 0.57 |
| 11 | 002078 | 太阳纸业 | 705,439.00 | 0.57 |
| 12 | 600969 | 郴电国际 | 699,120.00 | 0.56 |
| 13 | 600561 | 江西长运 | 697,327.00 | 0.56 |
| 14 | 600356 | 恒丰纸业 | 694,825.00 | 0.56 |
| 15 | 600239 | 云南城投 | 693,378.00 | 0.56 |
| 16 | 603311 | 金海环境 | 693,359.00 | 0.56 |
| 17 | 002419 | 天虹商场 | 692,346.00 | 0.56 |
| 18 | 600815 | 厦工股份 | 691,704.00 | 0.56 |
| 19 | 000949 | 新乡化纤 | 691,141.00 | 0.55 |
| 20 | 002187 | 广百股份 | 688,773.97 | 0.55 |

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 | 002267 | 陕天然气 | 586,525.00 | 0.47 |
| 2 | 000418 | 小天鹅 A | 554,600.00 | 0.45 |
| 3 | 601107 | 四川成渝 | 508,375.00 | 0.41 |
| 4 | 600114 | 东睦股份 | 507,653.00 | 0.41 |
| 5 | 600054 | 黄山旅游 | 501,217.00 | 0.40 |
| 6 | 600803 | 新奥股份 | 495,842.00 | 0.40 |
| 7 | 002054 | 德美化工 | 491,863.00 | 0.39 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 8 | 600829 | 人民同泰 | 482,566.77 | 0.39 |
| 9 | 600981 | 汇鸿集团 | 467,753.00 | 0.38 |
| 10 | 600859 | 王府井 | 462,908.00 | 0.37 |
| 11 | 000404 | 华意压缩 | 461,495.53 | 0.37 |
| 12 | 002406 | 远东传动 | 461,328.00 | 0.37 |
| 13 | 600823 | 世茂股份 | 457,308.16 | 0.37 |
| 14 | 002068 | 黑猫股份 | 456,126.20 | 0.37 |
| 15 | 300121 | 阳谷华泰 | 456,021.64 | 0.37 |
| 16 | 000965 | 天保基建 | 454,759.00 | 0.37 |
| 17 | 000550 | 江铃汽车 | 453,938.10 | 0.36 |
| 18 | 002637 | 赞宇科技 | 453,418.00 | 0.36 |
| 19 | 000823 | 超声电子 | 452,569.80 | 0.36 |
| 20 | 300138 | 晨光生物 | 452,110.20 | 0.36 |

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

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 228,624,070.75 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 132,544,780.16 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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**

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 30,709.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 2,749.07 |
| 5 | 应收申购款 | 3,205,096.37 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 3,238,554.57 |

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

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 | 600203 | 福日电子 | 529,920.00 | 0.43 | |

§ 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

| 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 |
| 1,640 | 67,692.98 | 10,992,113.49 | 9.90% | 100,024,367.28 | 90.10% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 1,289,488.35 | 1.16% |

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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年1月22日)基金份额总额 | 202,639,215.47 |
| 基金合同生效日基金份额总额 | 202,639,215.47 |

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 95,837,134.61 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 187,459,869.31 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 111,016,480.77 |

§ 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，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

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，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

| 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比 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | | |
|--------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 第一创业证券 | 2 | 121,038,725.98 | 33.51% | 87,235.84 | 30.46% | — |
| 国信证券 | 2 | 130,483,706.04 | 36.13% | 120,084.81 | 41.93% | — |
| 银河证券 | 2 | 109,646,418.89 | 30.36% | 79,040.3 | 27.6% | — |
| 东兴证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 中信建投证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 中银国际证券 | 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。

本基金报告期内新增东兴证券2个交易单元、中银国际证券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

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 | |
|--------|------|-------------|---------------|---------------|------|-------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 第一创业证券 | — | — | 1,149,000,000 | 67.99% | — | — |
| 国信证券 | — | — | 205,000,000 | 12.13% | — | — |

| | | | | | | |
|------------|---|---|-----------------|--------|---|---|
| 银河证券 | — | — | 336,000, 000 | 19.88% | — | — |
| 东兴证券 | — | — | — | — | — | — |
| 中信建投证 券 | — | — | — | — | — | — |
| 中银国际证 券 | — | — | — | — | — | — |

创金合信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日