

创金合信量化多因子股票型证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 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

报告送出日期:2017 年 08 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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 2017 年 8 月 21 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 2017 年 01 月 01 日起至 2017 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01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	1,551,376,481.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
下属分级基金的交易代码	002210	003865
报告期末下属分级基金的份额总额	1,463,466,274.82份	87,910,206.60份

注:本基金于2017年1月6日起,增设C类基金份额,本基金原有基金份额全部自动化归为A类基金份额。

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	本基金为股票型基金,股票投资部分占基金资产的比例不低于80%。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。
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。

下属分级基金的风险收益特征	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。	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
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
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(2017年01月01日-2017年06月30日)	
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
本期已实现收益	-223,637,818.39	-6,972,125.58
本期利润	-176,912,021.70	-7,480,291.17

加权平均基金份额本期利润	-0.1172	-0.1527
本期基金份额净值增长率	-9.78%	-11.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1146	0.1114
期末基金资产净值	1,647,195,710.13	98,659,740.14
期末基金份额净值	1.1260	1.1220

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. 本基金C类份额自2017年1月6日起增设，截至报告期末，本基金C类成立不满半年，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

创金合信量化多因子股票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	4.26%	1.05%	5.02%	0.84%	-0.76%	0.21%
过去三个月	-7.25%	1.10%	-3.20%	0.92%	-4.05%	0.18%
过去六个月	-9.78%	1.00%	-0.78%	0.81%	-9.00%	0.19%
过去一年	0.36%	0.95%	2.33%	0.82%	-1.97%	0.13%
自基金合同生效起至今	12.60%	1.00%	7.21%	1.29%	5.39%	-0.29%

创金合信量化多因子股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	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
----	----------	------------	------------	---------------	-----	-----

		准 差 ②				
过去一个月	4.18%	1.04%	5.02%	0.84%	-0.84%	0.20%
过去三个月	-7.50%	1.09%	-3.20%	0.92%	-4.30%	0.17%
自基金合同 生效起至今	-11.02 %	1.00%	-2.71%	0.81%	-8.31%	0.19%

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

创金合信量化多因子股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年01月22日-2017年06月30日)



创金合信量化多因子股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年01月06日-2017年06月30日)



§ 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4只公募基金。截至2017年6月30日，本公司共管理27只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品10只、股票型产品3只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约153.51亿元。

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	2016-01-22	-	10年	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、基金经理。
庞世恩	基金经理	2016-01-25	-	6年	庞世恩先生，中国国籍，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、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。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，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36次，为基金在调仓时点因选股模型和其他基金选股模型产生分歧而发生的反向交易，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

回顾2017年上半年，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，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为-9.78%，A类份额同期业绩比较基准收益率为-0.78%；C类净值增长率为-11.02%，C类份额同期业绩比较基准收益率为-2.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去的半年里，经济数据超预期。2季度GDP及6月份工业、投资、消费、进出口增长均超预期，工业生产延续强势，收入回升支撑消费，企业盈利改善。目前CPI水平较低，因为通胀引发货币政策收紧的可能性很小。经历了过去两年市场调整，当前股市估值略偏低；增量资金进场意愿不明显，市场依然存在较多的结构性机会。

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。

本基金管理人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2017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：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：		
银行存款	147,877,256.53	106,762,583.54
结算备付金	65,913,600.92	11,184,474.88
存出保证金	10,846,803.24	303,926.67
交易性金融资产	1,531,292,935.06	1,673,429,432.06
其中：股票投资	1,531,292,935.06	1,673,429,432.06
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	11,028,100.06	30,012,675.00
应收利息	143,223.57	33,006.64
应收股利	-	-
应收申购款	1,714,094.19	14,654,682.93
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,768,816,013.57	1,836,380,781.72
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2017年06月30日	2016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	17,279,291.25	967,767.56
应付管理人报酬	2,124,916.91	2,069,861.38
应付托管费	354,152.81	344,976.87
应付销售服务费	52,951.28	-
应付交易费用	3,030,551.32	1,226,311.47
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	118,699.73	156,105.07
负债合计	22,960,563.30	4,765,022.35
所有者权益:		
实收基金	1,551,376,481.42	1,467,906,594.71
未分配利润	194,478,968.85	363,709,164.66
所有者权益合计	1,745,855,450.27	1,831,615,759.37
负债和所有者权益总计	1,768,816,013.57	1,836,380,781.72

注:1. 报告截止日2017年6月30日, 基金份额总额1,551,376,481.42份, 其中下属A类基金份额1,463,466,274.82份, C类基金份额87,910,206.60份。下属A类基金份额净值1.126元, C类基金份额净值1.122元。

2. 本基金合同生效日为2016年1月22日, 上年度可比期间为2016年1月22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: 2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2017年01月01日至 2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生 效日）至2016年06月30日
一、收入	-147,840,406.37	11,895,294.16
1. 利息收入	1,321,592.59	247,043.63
其中：存款利息收入	652,191.96	62,644.83
债券利息收入	52,650.03	-
资产支持证券利息收 入	-	-
买入返售金融资产收 入	616,750.60	184,398.80
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）	-198,117,630.69	7,919,422.49
其中：股票投资收益	-194,803,472.62	7,447,134.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	118,188.07	-
资产支持证券投资收 益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-9,962,972.73	-
股利收益	6,530,626.59	472,288.22
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	46,217,631.10	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）	2,738,000.63	1,256,331.85
减：二、费用	36,551,906.50	1,193,107.44
1. 管理人报酬	13,633,997.84	575,752.40
2. 托管费	2,272,333.01	95,958.76

3. 销售服务费	187,450.96	-
4. 交易费用	20,358,236.69	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	99,888.00	70,449.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-184,392,312.87	10,702,186.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-184,392,312.87	10,702,186.72

注：本基金合同生效日为2016年1月22日，上年度可比期间为2016年1月22日至2016年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017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)	1,467,906,594.71	363,709,164.66	1,831,615,759.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-184,392,312.87	-184,392,312.87
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)	83,469,886.71	15,162,117.06	98,632,003.77
其中：1. 基金申购款	745,547,927.17	147,508,571.10	893,056,498.27
2. 基金赎回款	-662,078,040.46	-132,346,454.04	-794,424,494.50

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）	1,551,376,481.42	194,478,968.85	1,745,855,450.27
项 目	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生效日）至2016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）	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

注：本基金合同生效日为2016年1月22日，上年度可比期间为2016年1月22日至2016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]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。本基金于2017年1月6日起,增设C类基金份额,本基金原有基金份额全部自动化归为A累基金份额。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%。

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本报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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[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改为缴纳增值税。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。

(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。

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	关联方与本基金的关系
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(“中国工商银行”)	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

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年 06月30日		上年度可比期间 2016年01月22日(基金合 同生效日)至2016年06月3 0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	2,806,790,729.64	14.84	121,038,725.98	33.51

6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本期末及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年	上年度可比期间 2016年01月22日(基金合
-------	-------------------------	----------------------------

	06月30日		同生效日)至2016年06月30日	
	债券回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
第一创业证券股份有限公司	800,000,000.00	17.71	1,149,000,000.00	67.99

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本期末及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017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	1,851,102.90	20.09	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月22日(基金合同生效日)至2016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	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。

6.4.8.2 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 2017年01月01日 至2017年06月30 日	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同 生效日）至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,633,997.84	575,752.40
其中：支付销售机构的客户维护费	7,793,323.07	320,378.48

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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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3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

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年06月30 日	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同 生效日）至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,272,333.01	95,958.76

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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 2017年01月01日至2017年06月30日		
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C	合计
创金合信基金	-	329.07	329.07
工商银行	-	216.47	216.47
合计	-	545.54	545.54

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.75%/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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（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 2017年01月01日至2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生效日）至2016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活期存款	147,877,256.53	399,241.14	16,839,900.93	48,987.04
------------------	----------------	------------	---------------	-----------

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

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 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(2017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

6.4.9.1.1 受限证券类别: 股票										
代码	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	期末成本总额	期末估值总额	说明
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

				受限						
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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

代码	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	备注说明
600603	广汇物流	2017-06-15	重大事项停牌	11.81	2017-07-27	11.71	730,909	9,839,017.80	8,632,035.29	-
000862	银星能源	2017-03-13	重大事项停牌	7.90	-	-	858,889	7,044,709.80	6,785,223.10	-
600057	象屿股份	2017-06-27	重大事项停牌	10.17	2017-07-04	10.17	542,667	5,487,826.68	5,518,923.39	-
601313	江南嘉捷	2017-06-12	重大事项停牌	8.79	-	-	590,615	5,376,806.23	5,191,505.85	-
002696	百洋股份	2017-06-22	重大事项停牌	20.87	2017-07-03	21.74	245,300	4,658,029.99	5,119,411.00	-
600602	云赛智联	2017-06-22	重大事项	7.51	2017-07-04	7.80	597,417	4,920,406.	4,486,601.	-

			停牌					64	67	
000662	天夏智慧	2017-06-05	重大事项停牌	16.00	-	-	246,100	4,065,622.11	3,937,600.00	-
000038	深大通	2017-05-12	重大事项停牌	31.74	-	-	114,686	4,705,797.67	3,640,133.64	-
300092	科新机电	2017-04-14	重大事项停牌	12.70	-	-	190,460	2,578,602.02	2,418,842.00	-
300108	双龙股份	2017-05-12	重大事项停牌	7.75	2017-08-04	8.35	270,700	2,380,749.65	2,097,925.00	-
002526	山东矿机	2017-06-12	重大事项停牌	7.47	2017-07-03	7.58	260,500	1,889,281.19	1,945,935.00	-
002006	精功科技	2017-05-22	重大事项停牌	7.91	-	-	211,855	1,742,096.78	1,675,773.05	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项停牌	11.46	-	-	109,900	1,392,962.61	1,259,454.00	-
002748	世龙实业	2017-06-29	重大事项停牌	19.45	2017-07-05	20.00	58,500	1,088,085.29	1,137,825.00	-
300461	田中精机	2017-05-10	重大事项停牌	64.25	-	-	17,000	1,166,911.90	1,092,250.00	-
300500	启迪设计	2017-04-17	重大事项停牌	34.03	2017-07-12	30.64	26,800	997,210.13	912,004.00	-
600653	申华控股	2017-05-08	重大事项	3.26	-	-	174,100	588,536.21	567,566.00	-

			停牌							
000610	西安旅游	2017-05-22	重大事项停牌	11.43	2017-07-24	10.71	24,300	275,227.41	277,749.00	-
600462	九有股份	2017-03-24	重大事项停牌	8.14	2017-07-19	7.33	29,800	241,925.00	242,572.00	-

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2017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2017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2017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1,474,229,922.97元，属于第二层次的余额为57,063,012.09元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次1,636,281,318.02元，第二层次37,148,114.04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2017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(2016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) 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	1,531,292,935.06	86.57
	其中：股票	1,531,292,935.06	86.57
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	213,790,857.45	12.09
7	其他各项资产	23,732,221.06	1.34

8	合计	1,768,816,013.57	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	21,015,922.96	1.20
B	采矿业	27,214,467.06	1.56
C	制造业	1,015,691,582.79	58.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,954,586.34	4.87
E	建筑业	19,003,269.16	1.09
F	批发和零售业	107,402,566.20	6.15
G	交通运输、仓储和邮政业	39,112,858.54	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,901,579.02	3.14
J	金融业	4,403,697.90	0.25
K	房地产业	59,841,870.76	3.43
L	租赁和商务服务业	32,125,054.72	1.84
M	科学研究和技术服务业	27,483,048.36	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	12,124,933.46	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,930,646.81	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,188,463.69	0.87
S	综合	8,898,387.29	0.51
	合计	1,531,292,935.06	87.71

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	600603	广汇物流	730,909	8,632,035.29	0.49
2	603567	珍宝岛	468,643	7,887,261.69	0.45
3	000761	本钢板材	1,503,200	7,861,736.00	0.45
4	300360	炬华科技	522,038	7,856,671.90	0.45
5	300179	四方达	1,200,697	7,852,558.38	0.45
6	600723	XD首商股	879,430	7,844,515.60	0.45
7	300120	经纬电材	596,635	7,839,783.90	0.45
8	600438	通威股份	1,400,100	7,812,558.00	0.45
9	600736	苏州高新	1,103,379	7,800,889.53	0.45
10	000990	诚志股份	487,840	7,795,683.20	0.45

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	300456	耐威科技	24,405,601.31	1.33
2	000046	泛海控股	23,817,730.57	1.30
3	600982	宁波热电	23,542,223.95	1.29
4	002369	卓翼科技	23,235,338.54	1.27
5	000886	海南高速	23,035,131.53	1.26
6	002171	楚江新材	22,658,659.59	1.24
7	603567	珍宝岛	22,580,381.33	1.23
8	600713	南京医药	22,499,807.17	1.23
9	300365	恒华科技	22,305,417.21	1.22
10	600218	全柴动力	22,132,342.64	1.21
11	600883	博闻科技	21,666,921.19	1.18
12	000949	新乡化纤	21,340,641.69	1.17

13	300277	海联讯	21,072,358.99	1.15
14	000739	普洛药业	21,004,956.72	1.15
15	600090	同济堂	20,929,292.62	1.14
16	300120	经纬电材	20,824,701.09	1.14
17	002337	赛象科技	20,620,549.96	1.13
18	000415	渤海金控	20,608,401.27	1.13
19	002150	通润装备	20,591,823.12	1.12
20	002181	粤传媒	20,409,939.63	1.11

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	300082	奥克股份	24,456,153.56	1.34
2	002369	卓翼科技	23,469,086.17	1.28
3	002350	北京科锐	22,611,821.18	1.23
4	300389	艾比森	22,193,260.41	1.21
5	002150	通润装备	21,972,995.27	1.20
6	300365	恒华科技	21,705,430.51	1.19
7	600713	南京医药	21,654,411.31	1.18
8	002511	中顺洁柔	21,570,207.95	1.18
9	600665	天地源	21,488,757.44	1.17
10	000046	泛海控股	20,494,782.92	1.12
11	000739	普洛药业	20,386,847.75	1.11
12	600057	象屿股份	19,708,304.15	1.08
13	600335	国机汽车	19,674,767.01	1.07
14	000949	新乡化纤	19,667,197.70	1.07
15	000666	经纬纺机	19,557,221.92	1.07
16	002370	亚太药业	19,475,574.58	1.06
17	002420	毅昌股份	19,433,520.85	1.06

18	000591	太阳能	19,153,511.43	1.05
19	300130	新国都	19,017,754.52	1.04
20	002661	克明面业	18,879,741.31	1.03

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	9,462,082,246.42
卖出股票的收入(成交)总额	9,456,403,987.17

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1709	IC1709	12	14,452,320.00	-418,001.74	符合本基金的收益风险特征
IC1712	IC1712	29	34,282,640.00	-353,083.53	符合本基金的收益风险特征

公允价值变动总额合计（元）	-771,085.27
股指期货投资本期收益（元）	-9,962,972.73
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-771,085.27

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的，包括多头套保和空头套保。本报告期进行了少量的多头套保。

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发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	10,846,803.24
2	应收证券清算款	11,028,100.06
3	应收股利	-
4	应收利息	143,223.57
5	应收申购款	1,714,094.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,732,221.06

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。

7.12.5.1 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	流通受限部分公允价值	占基金净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600603	广汇物流	8,632,035.29	0.49	重大事项停牌

§ 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 (%)
创金合信量化多因子股票A	65,170	22,456.13	122,634,950.80	8.38	1,340,831,324.02	91.62
创金合信量化多因子股票C	17,521	5,017.42	26,833,631.48	30.52	61,076,575.12	69.48
合计	80,772	19,206.86	149,468,582.28	9.63	1,401,907,899.14	90.37

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	创金合信量化多因 子股票A	2,379,034.16	0.16
	创金合信量化多因 子股票C	50,756.42	0.06
	合计	2,429,790.58	0.16

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	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	创金合信量化多因 子股票A	0~10
	创金合信量化多因 子股票C	0.00
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	创金合信量化多因 子股票A	0.00
	创金合信量化多因 子股票C	0.00
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信量化多因子股 票A	创金合信量化多因子股 票C
基金合同生效日(2016年01月22 日)基金份额总额	202,639,215.47	-
本报告期期初基金份额总额	1,467,906,594.71	-
本报告期期间基金总申购份额	634,708,469.49	110,839,457.68

减：本报告期期间基金总赎回份 额	639, 148, 789. 38	22, 929, 251. 08
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	1, 463, 466, 274. 82	87, 910, 206. 60

§ 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，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。

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	佣金	占当期 佣金总 量的比	

			比例(%)		例(%)	
第一创业证券	2	2,806,790,729.64	14.84	1,851,102.90	20.09	-
兴业证券	2	2,145,932,758.17	11.35	898,567.82	9.75	-
金元证券	2	228,836,175.86	1.21	48,348.33	0.52	-
招商证券	2	1,671,406,274.87	8.84	691,470.25	7.50	-
国信证券	2	142,297,402.60	0.75	69,610.76	0.76	-
银河证券	2	986,904,793.47	5.22	701,982.21	7.62	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	2,454,538,505.74	12.98	2,136,723.24	23.19	-
东兴证券	2	344,106,452.05	1.82	114,035.27	1.24	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	4,563,639,484.07	24.13	1,568,843.15	17.02	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	3,569,459,642.72	18.87	1,135,279.98	12.32	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	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中信证券，天风证券，申万宏源证券，兴业证券，广发证券，安信证券、中投证券、华泰证券、长江证券9家券商的18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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购交易成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例 (%)
第一创业证券	-	-	800,000.00	17.71	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,055,000.00	23.36	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,085,971.00	100.00	10,000,000.00	0.22	-	-	-	-
国信证券	-	-	25,000,000.00	0.55	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	85,000,000.00	1.88	-	-	-	-
东兴证券	-	-	70,000,000.00	1.55	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,040,000.00	45.16	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	432,000.00	9.56	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内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
二〇一七年八月二十五日