

# 创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45

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 .....	45
§9 开放式基金份额变动 .....	45
§10 重大事件揭示 .....	45
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§12 备查文件目录 .....	51
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	创金沪港深精选混合
基金主代码	001662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月24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	1,062,417,334.28份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取灵活的资产配置体系，通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类别资产的风险收益特征水平进行综合分析，并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标，灵活动态地调整固定收益类资产和权益类资产的比例，以规避或控制市场系统性风险，从而实现长期稳健增长的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，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
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	北京市西城区复兴门内大街 5 号
办公地址		深圳市福田区福华一路 15 号投行大厦 15 层	北京市西城区复兴门内大街 5 号
邮政编码		518000	100140
法定代表人		刘学民	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	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）
本期已实现收益	46,953,630.03
本期利润	-49,934,049.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0593
本期加权平均净值利润率	-5.38%
本期基金份额净值增长率	-0.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	72,405,505.26
期末可供分配基金份额利润	0.0682
期末基金资产净值	1,134,822,839.54
期末基金份额净值	1.068
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	6.80%

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。

### 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	1.62%	0.68%	2.42%	0.34%	-0.80%	0.34%
过去三个月	-5.49%	0.87%	3.37%	0.32%	-8.86%	0.55%
过去六个月	-0.19%	0.84%	6.53%	0.31%	-6.72%	0.53%

过去一年	19.20%	0.89%	9.38%	0.38%	9.82%	0.51%
自基金合同生效起至今	6.80%	1.16%	4.51%	0.74%	2.29%	0.42%

### 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

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年08月24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		
张荣	基金经理	2015-08-24	-	7年	张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下，把握行业趋势；2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。
李晗	基金经理	2015-08-24	-	10年	李晗先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士，金融风险管理师（FRM），权益投资基金经理。投资中注重基本面研究，寻找行业和企业发展的拐点，擅长挖掘估值合理的持续成长股，与优质企业共同成长中获取丰厚回报。曾任职于海航集团从事并购整合业务。此后任职于鹏华基金，从事专户业务、企业年金业务的研究工作。2009年11月加盟第一创业证券资产管理部，曾担任多个集合理财产品投资主办，

					投资经验丰富。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
陈玉辉	基金经理、投资一部总监	2015-08-24	-	14年	陈玉辉先生，中国国籍，经济学硕士，2003年6月加入新疆证券有限责任公司，从事石化行业研究；2005年度获中央电视台、中国证券报联合评选的首届“全国十佳证券分析师”。2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所，任化工行业研究员。2008年3月加入招商基金管理有限公司，历任研究部副总监、总监，并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年7月任创金合信基金管理有限公司投资一部总监、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，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

2017年上半年市场风格明显分为两个阶段，一季度延续去年的主题、板块一九轮动，板块和个股机会分散但个股相对活跃；4月初雄安主题后，市场风格转变为金融、消费、电子等极少数板块中相对低市盈率的白马蓝筹核心股票单边上涨、绝大部分个股连续急跌两个月的极端分化行情。

基金组合一直采取“低估值，低市值，低涨幅”的三低策略，个股选择倾向于低PB，一年多时间内超额收益显著。但二季度以后市场转向低PE风格，组合中低PB策略的中小市值国企股也跟随全市场绝大部分小市值风格出现较大幅度调整，导致二季度组合高点回撤幅度较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，创金沪港深精选混合净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为6.53%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年行情分析建立在对板块当前估值和历史超额收益的分析基础之上，按照股价内在运行规律划分为大市值指标股、中等市值消费白马股和中小市值三个风格板块来看：

第一，大型金融、央企指标股中少部分如中国平安、招商银行等近一年多来出现了接近翻倍的涨幅，但其它板块的指标个股距离近两年低点涨幅较小，未来可能会继续轮动，带动上证50、上证指数等大市值风格指数保持区间内相对稳定。

第二，消费白马股票如白酒、家电、汽车、苹果概念电子股今年和过去三年累计涨幅和超额收益过大，相对和绝对估值很多已经进入历史高位。二季度白马股平均上涨20%，中小市值平均下跌约20%，双向剪刀差超额收益达到50%，按照超额收益的均值回归规律，白马股未来风险收益比显著下降。

第三类是占市场个股数量绝大部分的中小市值风格板块，虽然2016年个股中位数平

均跌幅17%，2017年初以来又下跌约12%，但如果按照2倍左右市净率作为合理价值中枢，大部分个股仍然处于非投资区域的绝对高位。市场通过反复振荡下跌消化中小市值板块整体高估值，因此此板块仍然难有系统性指数化收益机会。中小市值中存在两类机会：一是每轮下跌后，进入投资区域的个股比例会增加，会有更多机会进行个股选择；第二，每轮下跌后的休整期，反弹过程中会出现局部板块热点领涨的一九轮动主题机会。

在当前市场三分法分析逻辑下，2017年下半年的投资仍然保持中性仓位，以控制系统性风险和预留逢低买入的仓位机会，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”选股和交易策略，采取逢低买入向下风险小，低估值、低涨幅个股的类看涨期权策略；由于大小非减持、定增解禁等各种杠杆资金退出成为2017年市场主要风险因素，因此优先配置减持风险小的央企和国企中流动性相对较高的品种。

主题方面紧跟国家政策，相对看好国企改革在十九大之前加速推进的机会。习近平总书记在全国金融工作会议上提出，要把国有企业降杠杆作为重中之重，积极稳妥推进去杠杆，深化国企改革，把降低国企杠杆率作为重中之重。这一新的提法，与2014年一带一路、京津冀两项国策，2016年供给侧和国企改革两项经济任务一样，预计可能成为未来中央各金融、行政部门主要工作任务，股票市场会在国企改革、重组、融资等方面有所反映。若仅依靠股票市场IPO融资，年直接融资仅几千亿规模，而国有企业场外混改和债转股等才是容量更大的直接融资市场，如前期腾讯等民企参股中石化销售公司、管道公司两个子公司混改融资超过一千亿，显示传统国有企业在并购、重组、再融资去杠杆方面有很大金融创新空间。

#### 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沪港深研究精选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，创金合信沪港深研究精选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沪港深研究精选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，创金合信沪港深研究精选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沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2017年06月30日	2016年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	78,044,948.50	54,338,479.72
结算备付金		39,057,650.31	358,101.11
存出保证金		281,971.75	82,600.56
交易性金融资产	6.4.7.2	751,216,197.38	188,257,722.96
其中: 股票投资		751,216,197.38	188,257,722.96
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	270,000,000.00	-
应收证券清算款		79,748.23	-
应收利息	6.4.7.5	-73,526.27	6,923.51
应收股利		107,512.00	-
应收申购款		1,013,155.74	21,557,993.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,139,727,657.64	264,601,821.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		0.47	13,748,271.71
应付赎回款		2,743,677.96	946,340.85
应付管理人报酬		1,407,639.96	226,640.62
应付托管费		234,606.66	37,773.44

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	433,215.79	150,837.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,677.26	66,605.15
负债合计		4,904,818.10	15,176,469.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,062,417,334.28	233,089,922.59
未分配利润	6.4.7.1 0	72,405,505.26	16,335,429.66
所有者权益合计		1,134,822,839.54	249,425,352.25
负债和所有者权益总计		1,139,727,657.64	264,601,821.48

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.068元，基金份额总额1,062,417,334.28份。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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01日至2016年06月30日
<b>一、收入</b>		-40,611,891.22	-22,216,240.04
1. 利息收入		4,320,393.33	159,066.54
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	449,292.33	136,085.29
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		3,871,101.00	22,981.25

入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,238,118.26	-22,708,233.82
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	47,983,210.60	-23,283,118.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	1,254,907.66	574,885.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-96,887,679.48	295,340.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	2,717,276.67	37,586.76
<b>减：二、费用</b>		9,322,158.23	2,832,828.46
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	6,806,863.40	1,512,165.92
2. 托管费	6.4.10. 2.2	1,134,477.19	252,027.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	1,301,294.29	981,947.57
5. 利息支出		-	-



其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.2 0	79,523.35	86,687.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,934,049.45	-25,049,068.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,934,049.45	-25,049,068.50

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

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)	233,089,922.59	16,335,429.66	249,425,352.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-49,934,049.45	-49,934,049.45
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）	829,327,411.69	106,004,125.05	935,331,536.74
其中：1. 基金申购款	1,404,491,465.97	177,144,605.02	1,581,636,070.99
2. 基金赎回款	-575,164,054.28	-71,140,479.97	-646,304,534.25
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	1,062,417,334	72,405,505.26	1,134,822,839.54

项 目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	净值)	.28	
一、期初所有者权益(基金净值)	248,272,977.05	-1,302,557.89	246,970,419.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-25,049,068.50	-25,049,068.50
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)	-24,283,334.77	3,052,141.61	-21,231,193.16
其中：1. 基金申购款	357,069.02	-46,038.54	311,030.48
2. 基金赎回款	-24,640,403.79	3,098,180.15	-21,542,223.64
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	223,989,642.28	-23,299,484.78	200,690,157.50

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

创金合信沪港深研究精选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]第1477号《关于准予创金合信沪港深研究精选灵活配置混合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《创金合信沪港深研究精选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303,724,280.18元，已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(2015)第987号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为303,868,723.06份基金份额，其中认购资金利息折合144,442.88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《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、股指期货、债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以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×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数(全价)收益率×40%。

#### 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》、《创金合信沪港深研究精选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。

#### 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 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2017年06月30日	
活期存款	78,044,948.50	
定期存款	0.00	
其中：存款期限1-3个月	-	
其他存款	0.00	
合计	78,044,948.50	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	840,043,049.28	751,216,197.38	-88,826,851.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00
合计	840,043,049.28	751,216,197.38	-88,826,851.90

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	270,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	270,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	15,311.49
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	17,576.00
应收债券利息	0.00
应收买入返售证券利息	-106,540.66
应收申购款利息	0.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	126.90
合计	-73,526.27

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	433,215.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	433,215.79

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,336.11
预提费用	79,341.15
合计	85,677.26

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	233,089,922.59	233,089,922.59
本期申购	1,404,491,465.97	1,404,491,465.97
本期赎回（以“-”号填列）	-575,164,054.28	-575,164,054.28
本期末	1,062,417,334.28	1,062,417,334.28

注：申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,804,960.39	8,530,469.27	16,335,429.66
本期利润	46,953,630.03	-96,887,679.48	-49,934,049.45
本期基金份额交易产生的变动数	47,469,898.98	58,534,226.07	106,004,125.05
其中：基金申购款	88,777,153.76	88,367,451.26	177,144,605.02
基金赎回款	-41,307,254.78	-29,833,225.19	-71,140,479.97
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	102,228,489.40	-29,822,984.14	72,405,505.26

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日
活期存款利息收入	308,029.65
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	139,721.10
其他	1,541.58
合计	449,292.33

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出股票成交总额	307,555,855.04
减：卖出股票成本总额	259,572,644.44
买卖股票差价收入	47,983,210.60

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金于本期无债券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金于本报告期无贵金属收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本期未发生衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,254,907.66
基金投资产生的股利收益	0.00
合计	1,254,907.66



## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
1. 交易性金融资产	-96,887,679.48
——股票投资	-96,887,679.48
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-96,887,679.48

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
基金赎回费收入	2,717,276.67
合计	2,717,276.67

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
交易所市场交易费用	1,301,294.29
银行间市场交易费用	-
合计	1,301,294.29

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	182.00
合计	79,523.35

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 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。

## 6.4.9.2 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	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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比区间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

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回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期及上年度可比区间无应支付关联方佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 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01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,806,863.40	1,512,165.92
其中：支付销售机构的客户维护费	4,049,148.37	951,873.44

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。

**6.4.10.2.2 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01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,134,477.19	252,027.67

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。

### 6.4.10.3 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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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01 日至2016年06 月30日
基金合同生效日（2015年08月24日）持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
报告期初持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9400%	4.4700%

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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20 17年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日至201 6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	78,044,948.50	308,029.65	16,139,622.37	112,848.45

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2017年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 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	-

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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 0.00 元，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 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 0.00 元，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金

融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年06月 30日	1年以内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	78,044,948.50	-	-	-	78,044,948.50
结算备付金	39,057,650.31	-	-	-	39,057,650.31
存出保证金	281,971.75	-	-	-	281,971.75
交易性金融资产	-	-	-	751,216,197.38	751,216,197.38
买入返售金融资产	270,000,000.00	-	-	-	270,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	79,748.23	79,748.23
应收利息	-	-	-	-73,526.27	-73,526.27
应收股利	-	-	-	107,512.00	107,512.00



应收申购款	-	-	-	1,013,155.74	1,013,155.74
资产总计	387,384,570.56	-	-	752,343,087.08	1,139,727,657.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.47	0.47
应付赎回款	-	-	-	2,743,677.96	2,743,677.96
应付管理人报酬	-	-	-	1,407,639.96	1,407,639.96
应付托管费	-	-	-	234,606.66	234,606.66
应付交易费用	-	-	-	433,215.79	433,215.79
其他负债	-	-	-	85,677.26	85,677.26
负债总计	-	-	-	4,904,818.10	4,904,818.10
利率敏感度缺口	387,384,570.56	-	-	747,438,268.98	1,134,822,839.54
上年度末2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,338,479.72	-	-	-	54,338,479.72
结算备付金	358,101.11	-	-	-	358,101.11
存出保证金	82,600.56	-	-	-	82,600.56
交易性金融资产	-	-	-	188,257,722.96	188,257,722.96
应收利息	-	-	-	6,923.51	6,923.51
应收申购款	-	-	-	21,557,993.62	21,557,993.62
资产总计	54,779,181.39	-	-	209,822,640.09	264,601,821.48
负债					

应付证券清算款	-	-	-	13,748,271.71	13,748,271.71
应付赎回款	-	-	-	946,340.85	946,340.85
应付管理人报酬	-	-	-	226,640.62	226,640.62
应付托管费	-	-	-	37,773.44	37,773.44
应付交易费用	-	-	-	150,837.46	150,837.46
其他负债	-	-	-	66,605.15	66,605.15
负债总计	-	-	-	15,176,469.23	15,176,469.23
利率敏感度缺口	54,779,181.39	-	-	194,646,170.86	249,425,352.25

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

截至2017年6月30日,沪港深外币计价交易性金融资产合计为2,101,234.32元,资产负债表外汇风险敞口净额为2,101,234.32元。上年度末(2016年12月31日),外币计价交易性金融资产合计为2,382,437.93元,资产负债表外汇风险敞口净额为2,382,437.93元。

在假设除汇率外其他市场变量保持不变情况下,本期末(2016年12月31日),若所有外币相对于人民币升值5%,则基金资产净值上升约105061.72元,若所有外币相对于人民币贬值5%,则基金资产净值下降约105061.72元。在假设除汇率外其他市场变量保持不变情况下,上年度末(2016年12月31日),若所有外币相对于人民币升值5%,则基金资产净值上升约119,121.90元,若所有外币相对于人民币贬值5%,则基金资产净值下降约119,121.90元。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-95%，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资比例为基金资产的5%-100%。其中，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例（ %）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	751,216,197.38	66.20	188,257,722.96	75.48
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	-	-	-	-
合计	751,216,197.38	66.20	188,257,722.96	75.48

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	42,425,924.80	12,425,009.72
	比较基准下降5%资产净值变动	-42,425,924.80	-12,425,009.72

## 6.4.14 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751,092,514.28元，属于第二层次的余额为123,683.10元，无属于第三层次的余额。（2016年12月31日：第一层次182,604,290.44元，第二层次5,653,432.52元，无第三层次）。

## (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	751,216,197.38	65.91
	其中：股票	751,216,197.38	65.91
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	270,000,000.00	23.69
	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	117,102,598.81	10.27
7	其他各项资产	1,408,861.45	0.12
8	合计	1,139,727,657.64	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为2,101,234.32元，占净值比为0.19%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	329,488,430.62	29.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,945,890.57	6.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	71,083,938.15	6.26
G	交通运输、仓储和邮政业	102,111,937.24	9.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	139,439,929.85	12.29
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	-	-
S	综合	33,037,197.01	2.91
	合计	749,114,963.06	66.01

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

港股通投资股票行业分类行业类别	港股通投资股票行业分类公允价值	港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比（%）
金融	1,051,919.04	0.09
能源	780,607.25	0.07
工业	268,708.03	0.02

合计	2,101,234.32	0.19%
----	--------------	-------

注：(1) 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

(2) 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600509	天富能源	9,716,937	73,945,890.57	6.52
2	600731	湖南海利	7,388,812	63,617,671.32	5.61
3	600888	新疆众和	9,475,508	58,558,639.44	5.16
4	601333	广深铁路	12,899,951	58,307,778.52	5.14
5	601818	光大银行	12,879,940	52,163,757.00	4.60
6	000001	平安银行	5,288,815	49,661,972.85	4.38
7	600125	铁龙物流	4,888,857	43,804,158.72	3.86
8	601998	中信银行	5,980,000	37,614,200.00	3.31
9	600192	长城电工	4,804,642	37,139,882.66	3.27
10	600859	王府井	2,118,823	34,218,991.45	3.02
11	600367	红星发展	3,035,336	33,054,809.04	2.91
12	600784	鲁银投资	4,953,103	33,037,197.01	2.91

13	000731	四川美丰	3,902,459	29,268,442.50	2.58
14	000422	湖北宜化	3,888,826	23,138,514.70	2.04
15	600883	博闻科技	1,898,556	22,156,148.52	1.95
16	600586	金晶科技	4,179,856	20,439,495.84	1.80
17	000554	泰山石油	2,126,307	17,223,086.70	1.52
18	600328	兰太实业	1,198,878	13,954,939.92	1.23
19	600858	银座股份	1,218,816	10,067,420.16	0.89
20	600429	三元股份	1,488,895	9,722,484.35	0.86
21	600778	友好集团	1,238,608	9,574,439.84	0.84
22	000729	燕京啤酒	1,288,859	8,661,132.48	0.76
23	000528	柳工	981,743	8,482,259.52	0.75
24	600889	南京化纤	99,905	948,098.45	0.08
25	H03328	交通银行	100,000	478,223.92	0.04
26	H01088	中国神华	30,000	452,533.49	0.04
27	H01898	中煤能源	100,000	328,073.76	0.03
28	H01288	农业银行	100,000	320,262.48	0.03
29	H00525	广深铁路股份	80,000	268,708.03	0.02
30	H06818	中国光大银行	80,000	253,432.64	0.02
31	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	-
32	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	-
33	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	-
34	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	-
35	002881	美格智能	989	22,608.54	-



36	603679	华体科技	809	21,438.50	-
37	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	-
38	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	-
39	603933	睿能科技	857	17,311.40	-
40	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	-
41	300669	沪宁股份	841	14,650.22	-
42	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	-
43	603286	日盈电子	890	13,528.00	-
44	300672	国科微	1,257	10,659.36	-
45	603331	百达精工	999	9,620.37	-
46	300671	富满电子	942	7,639.62	-
47	603617	君禾股份	832	7,429.76	-

#### 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	600509	天富能源	78,019,638.74	31.28
2	601333	广深铁路	68,595,024.19	27.50
3	601818	光大银行	61,770,361.10	24.77
4	600731	湖南海利	60,584,847.24	24.29
5	000778	新兴铸管	55,078,916.34	22.08
6	600192	长城电工	51,679,350.79	20.72
7	600888	新疆众和	47,878,881.86	19.20
8	600586	金晶科技	43,137,171.02	17.29
9	000731	四川美丰	39,427,670.88	15.81
10	000001	平安银行	38,657,108.79	15.50
11	600784	鲁银投资	38,318,312.01	15.36
12	600367	红星发展	38,080,188.22	15.27
13	000554	泰山石油	37,974,141.86	15.22

14	600125	铁龙物流	37,493,049.94	15.03
15	601998	中信银行	36,948,678.00	14.81
16	000422	湖北宜化	27,590,349.01	11.06
17	600859	王府井	27,193,364.50	10.90
18	000729	燕京啤酒	22,171,393.93	8.89
19	600883	博闻科技	20,024,037.69	8.03
20	600858	银座股份	14,471,240.37	5.80
21	600328	兰太实业	13,886,897.34	5.57
22	600778	友好集团	12,554,697.18	5.03
23	600429	三元股份	11,859,752.06	4.75
24	000709	河钢股份	8,796,097.75	3.53
25	000528	柳工	7,969,927.72	3.20
26	600801	华新水泥	7,815,133.34	3.13

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	000778	新兴铸管	93,629,671.97	37.54
2	000709	河钢股份	30,144,920.00	12.09
3	600586	金晶科技	27,730,575.00	11.12
4	000554	泰山石油	23,737,601.77	9.52
5	600801	华新水泥	15,513,096.61	6.22
6	000877	天山股份	15,011,499.78	6.02
7	601818	光大银行	14,231,512.00	5.71
8	000528	柳工	11,517,036.59	4.62
9	600509	天富能源	11,486,277.48	4.61
10	000729	燕京啤酒	10,497,591.90	4.21
11	000422	湖北宜化	9,479,015.00	3.80
12	600328	兰太实业	5,395,414.52	2.16

13	600858	银座股份	5,180,834.00	2.08
14	600192	长城电工	3,640,446.98	1.46
15	000731	四川美丰	2,956,165.00	1.19
16	600889	南京化纤	2,852,204.23	1.14
17	601333	广深铁路	2,748,114.64	1.10
18	600125	铁龙物流	2,570,800.00	1.03
19	600778	友好集团	1,213,246.38	0.49
20	600883	博闻科技	1,025,451.00	0.41

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	919,418,798.34
卖出股票的收入(成交)总额	307,555,855.04

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所有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

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 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	281,971.75
2	应收证券清算款	79,748.23
3	应收股利	107,512.00
4	应收利息	-73,526.27
5	应收申购款	1,013,155.74
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,408,861.45

### 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

注：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

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( %)
45,676	23,259.86	49,948,984.35	4.70	1,012,468,349.93	95.30

## 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	2,325,994.33	0.22

## 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	10~50
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(2015年08月24日)基金份额总额	303,868,723.06
本报告期期初基金份额总额	233,089,922.59
报告期期间基金总申购份额	1,404,491,465.97
减：报告期期间基金总赎回份额	575,164,054.28
报告期期间基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	1,062,417,334.28

## § 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比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券	2	285,688,404.82	23.37	207,945.33	23.49	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	5	-	-	-	-	-
国信证券	5	303,659,899.08	24.84	217,800.38	24.61	-
银河证券	5	296,315,296.43	24.24	214,992.31	24.29	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
申万宏源	5	-	-	-	-	-

中信建投证券	5	-	-	-	-	-
东兴证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中泰证券	5	336,294,058.69	27.51	244,020.66	27.57	-
长江证券	5	-	-	-	-	-
中银国际证券	5	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
天风证券	5	-	-	-	-	-
中投证券	5	-	-	-	-	-
华安证券	5	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-

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额的比	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 (%)

				例 (%)		)		)
招商证券	-	-	5,720,000.00	21.64	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,050,000.00	7.75	-	-	-	-
银河证券	-	-	17,530,000.00	66.31	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	1,135,400.00	4.29	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-



## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、中国证券报	2017-01-01
2	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金申购及赎回金额的公告	公司官网、中国证券报	2017-01-04
3	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金开展费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2017-01-11
4	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购和赎回份额额度及最低持有份额额度的公告	公司官网、中国证券报	2017-01-18
5	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	公司官网、中国证券报	2017-01-23
6	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加蛋卷基金为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-01-24
7	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	公司官网、中国证券报	2017-01-26
8	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加平安证券为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-09
9	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-10

10	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-16
11	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 暂停大额申购业务的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-18
12	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 关于增加微众银行为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-21
13	创金合信基金管理有限公司 关于直销柜台申购费率优惠政策调整的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-22
14	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 暂停大额申购业务的公告	公司官网、中国证券报	2017-02-25
15	创金合信基金管理有限公司 关于旗下创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金参与招商证券的费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2017-03-02
16	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式证券投资基金增加汇成基金为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-03-24
17	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告	公司官网、中国证券报	2017-03-27
18	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2017-03-27
19	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金	公司官网、中国证券报	2017-04-10

	(2017年第1号) 招募说明书(更新)		
20	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第1号)	公司官网、中国证券报	2017-04-10
21	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2017-04-21
22	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加安信证券为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-04-26
23	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加东莞证券股份有限公司为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-05-24
24	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加前海凯恩斯为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2017-06-05
25	创金合信基金管理有限公司关于开通旗下部分开放式基金转换业务的公告	公司官网、中国证券报	2017-06-13
26	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金及其代销机构一览表公告	公司官网、中国证券报	2017-06-23
27	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构暨参加代销机构费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2017-06-28

## § 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十五日